

AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Fiscal Strength Government Bonds

Rapport annuel au 31 mars 2024

Table des matières

| | |
|--|----|
| Direction du fonds et organisation | 2 |
| Information aux investisseurs | 3 |
| Utilisation du revenu net | 3 |
| Chiffres comptables | 4 |
| Inventaire et transactions | 8 |
| Notes aux états financiers | 37 |
| Rapport de performance | 39 |
| Rapport abrégé de la société d'audit | 40 |



Pl. St-François 14
Case postale 300
CH-1001 Lausanne

www.bcv.ch/invest



Rue du Maupas 2
Case postale 691
CH-1001 Lausanne

www.gerifonds.ch

Direction du fonds et organisation

Direction du fonds

GERIFONDS SA
Rue du Maupas 2
Case postale 691
1001 Lausanne

Conseil d'administration

Stefan BICHSEL
Président

Oren-Olivier PUDER
Vice-président

Fabrice WELSCH
Membre

Patrick BOTTERON
Membre

Simona TERRANOVA
Membre

Organe de gestion

Christian CARRON, Chief Executive Officer
Bertrand GILLABERT, Chief Financial Officer
Sandra BERCHIER, Chief Compliance Officer
Frédéric NICOLA, Chief Fund Risk & Regulatory Officer
Antonio SCORRANO, Chief Operating Officer

Banque dépositaire

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

Société d'audit

PricewaterhouseCoopers SA
Avenue Giuseppe-Motta 50
1202 Genève

Domicile(s) de souscription et de paiement

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

Gestion du fonds

GERIFONDS SA a délégué la gestion du fonds
à Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

Information aux investisseurs

1) Changement de société d'audit

PricewaterhouseCoopers SA, Genève, a été désignée comme société d'audit du fonds, en remplacement de KPMG SA, Genève. La nouvelle société d'audit assumera cette fonction depuis l'exercice annuel clôturant au 31 mars 2024.

Utilisation du revenu net au 31 mars 2024

Date Ex VNI : 31/08/2023

Date de paiement : 04/09/2023

| Classe | Affidavit | Coupon n° | Monnaie | Montant intermédiaire pour porteurs de parts domiciliés | | | |
|----------|-----------|-----------|---------|---|----------------------------------|--------------|--------------|
| | | | | en Suisse | | | à l'étranger |
| | | | | Brut par part | Impôt anticipé fédéral moins 35% | Net par part | Net par part |
| Classe C | Oui | 7 | CHF | 0.67781 | 0.23723 | 0.44058 | 0.67781 |

Date Ex VNI : 16/07/2024

Date de paiement : 18/07/2024

| Classe | Affidavit | Coupon n° | Monnaie | Montant pour porteurs de parts domiciliés | | | |
|----------|-----------|-----------|---------|---|----------------------------------|--------------|--------------|
| | | | | en Suisse | | | à l'étranger |
| | | | | Brut par part | Impôt anticipé fédéral moins 35% | Net par part | Net par part |
| Classe B | Oui | 7 | CHF | 1.40 | 0.49 | 0.91 | 1.40 |
| Classe C | Oui | 8 | CHF | 0.85 | 0.2975 | 0.5525 | 0.85 |
| Classe Z | Oui | 7 | CHF | 1.60 | 0.56 | 1.04 | 1.60 |

Chiffres comptables

| Aperçu | Devise | | 01.04.23 | 01.04.22 | 01.04.21 |
|---|------------|-----|----------------|----------------|----------------|
| | | | 31.03.24 | 31.03.23 | 31.03.22 |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | consolidée | CHF | 566'026'781.55 | 491'990'396.74 | 472'212'471.97 |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | classe B | CHF | 3'685'076.94 | 3'025'338.79 | 3'388'893.17 |
| Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable | classe B | CHF | 77.41 | 81.25 | 91.80 |
| Total Expense Ratio (TER) | classe B | | 0.42% | 0.42% | 0.42% |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | classe C | CHF | 61'935'813.80 | 161'792'200.45 | 76'229'906.94 |
| Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable | classe C | CHF | 77.13 | 81.69 | 92.31 |
| Total Expense Ratio (TER) | classe C | | 0.33% | 0.32% | 0.32% |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | classe Z | CHF | 500'405'890.81 | 327'172'857.50 | 392'593'671.86 |
| Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable | classe Z | CHF | 77.87 | 81.79 | 92.54 |
| Total Expense Ratio (TER) | classe Z | | 0.11% | 0.11% | 0.11% |

Le TER a été calculé et est publié conformément à la directive de l'Asset Management Association Switzerland AMAS.

| Compte de fortune (Valeurs vénales) | 31.03.24 | 31.03.23 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Avoirs en banque | | |
| à vue | 33'351'737.13 | 23'712'137.61 |
| Valeurs mobilières | | |
| Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs | 529'024'805.93 | 464'731'964.57 |
| Instruments financiers dérivés | -419'989.68 | -15'954.95 |
| Autres actifs | 6'807'111.84 | 3'629'122.31 |
| Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable | 568'763'665.22 | 492'057'269.54 |
| Engagements envers les banques à court terme | -420'739.97 | 0.00 |
| Autres engagements | -2'316'143.70 | -66'872.80 |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | 566'026'781.55 | 491'990'396.74 |

| Evolution du nombre de parts de la classe B | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|--|--------------------------|-----------------|-----------------|
| | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Position au début de la période comptable | | 37'236 | 36'916 |
| Parts émises | | 14'838 | 1'945 |
| Parts rachetées | | -4'472 | -1'625 |
| Position à la fin de la période comptable | | 47'602 | 37'236 |

| Evolution du nombre de parts de la classe C | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|--|--------------------------|-----------------|------------------|
| | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Position au début de la période comptable | | 1'980'466 | 825'805 |
| Parts émises | | 247'623 | 1'175'695 |
| Parts rachetées | | -1'425'061 | -21'034 |
| Position à la fin de la période comptable | | 803'028 | 1'980'466 |

| Evolution du nombre de parts de la classe Z | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|--|--------------------------|------------------|------------------|
| | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Position au début de la période comptable | | 4'000'333 | 4'242'427 |
| Parts émises | | 2'425'895 | 186'880 |
| Parts rachetées | | 0 | -428'974 |
| Position à la fin de la période comptable | | 6'426'228 | 4'000'333 |

| Variation de la fortune nette du fonds | | |
|--|-----------------------|-----------------------|
| Fortune nette du fonds au début de la période comptable | 491'990'396.74 | 472'212'471.97 |
| Distribution prévue lors de la dernière clôture annuelle | -9'221'592.00 | -8'416'243.70 |
| Distribution intermédiaire des revenus | -1'354'045.45 | 0.00 |
| Solde des mouvements de parts | 95'666'791.41 | 72'729'317.77 |
| Résultat total | -11'054'769.15 | -44'535'149.30 |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | 566'026'781.55 | 491'990'396.74 |

| Compte de résultat | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|---|-------------------|----------------|----------------|
| | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Revenus | | | |
| Revenus des avoirs en banque | | | |
| à vue | | 46'374.46 | 19'054.40 |
| Intérêts négatifs | | 0.00 | -15'670.79 |
| Revenus des valeurs mobilières | | | |
| Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs | | 11'505'224.42 | 9'184'318.48 |
| Participation des souscripteurs aux revenus nets courus | | 1'956'396.76 | 1'442'618.64 |
| Total des revenus | | 13'507'995.64 | 10'630'320.73 |
| Charges | | | |
| Intérêts passifs | | -142'109.67 | -38'661.94 |
| Bonifications réglementaires | | | |
| Commission forfaitaire de gestion | | -667'012.50 | -620'735.67 |
| Autres charges | | -115'243.91 | -72'320.86 |
| Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus | | -14'850.81 | -548'759.34 |
| Total des charges | | -939'216.89 | -1'280'477.81 |
| Résultat net | | 12'568'778.75 | 9'349'842.92 |
| Gains et pertes de capital réalisés | | -30'788'272.53 | -20'574'992.54 |
| Résultat réalisé | | -18'219'493.78 | -11'225'149.62 |
| Variation des gains et pertes de capital non réalisés | | 7'164'724.63 | -33'309'999.68 |
| Résultat total | | -11'054'769.15 | -44'535'149.30 |

| | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|--|-------------------|------------------|------------------|
| Utilisation du résultat de la classe B | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Résultat net | | 67'538.88 | 49'623.42 |
| Report de l'année précédente | | 2'647.15 | 1'430.53 |
| Résultat disponible pour être réparti | | 70'186.03 | 51'053.95 |
| Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs | | 66'642.80 | 48'406.80 |
| Report à compte nouveau | | 3'543.23 | 2'647.15 |
| Total | | 70'186.03 | 51'053.95 |

| | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|--|-------------------|---------------------|---------------------|
| Utilisation du résultat de la classe C | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Résultat net | | 1'899'375.34 | 2'886'170.64 |
| Report de l'année précédente | | 160'718.00 | 47'199.76 |
| Résultat disponible pour être réparti | | 2'060'093.34 | 2'933'370.40 |
| Distribution intermédiaire des revenus | | 1'354'045.45 | 0.00 |
| Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs | | 682'573.80 | 2'772'652.40 |
| Report à compte nouveau | | 23'474.09 | 160'718.00 |
| Total | | 2'060'093.34 | 2'933'370.40 |

| | Période comptable | 01.04.23 | 01.04.22 |
|--|-------------------|----------------------|---------------------|
| Utilisation du résultat de la classe Z | | 31.03.24 | 31.03.23 |
| Résultat net | | 10'601'864.53 | 6'414'048.86 |
| Report de l'année précédente | | 21'046.08 | 7'530.02 |
| Résultat disponible pour être réparti | | 10'622'910.61 | 6'421'578.88 |
| Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs | | 10'281'964.80 | 6'400'532.80 |
| Report à compte nouveau | | 340'945.81 | 21'046.08 |
| Total | | 10'622'910.61 | 6'421'578.88 |

Inventaire et transactions

Inventaire de la fortune du fonds à la fin de la période comptable

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|--|--|----------------|---------|-------------|-----------------------|--------------|
| Valeurs mobilières cotées en bourse | | | | | | |
| Obligations | | | | | 485'492'413.50 | 85.36 |
| AU0000013740 | 2 1/2 % Australia 18-30 NT | 510'000 | AUD | 93.31768 % | 279'658.63 | 0.05 |
| AU0000097495 | 1 3/4 % Australia 20-51 Series 162 NT | 1'400'000 | AUD | 58.67826 % | 482'724.56 | 0.08 |
| AU0000101792 | 1 % Australia 20-31 | 4'500'000 | AUD | 81.25391 % | 2'148'577.03 | 0.38 |
| AU000XCLWAG2 | 4 1/2 % Australia 13-33 Series 140 TB | 6'710'000 | AUD | 104.25554 % | 4'110'700.24 | 0.73 |
| AU000XCLWAP3 | 3 1/4 % Australia 15-39 NT | 1'350'000 | AUD | 89.58152 % | 710'634.56 | 0.12 |
| AU000XCLWAR9 | 2 1/4 % Australia 16-28 NT | 6'000'000 | AUD | 94.87997 % | 3'345'183.22 | 0.59 |
| AU3TB0000135 | 4 3/4 % Australia 11-27 NT Series 136 TB | 4'989'000 | AUD | 103.32 % | 3'028'949.43 | 0.53 |
| AU3TB0000168 | 3 1/4 % Australia 13-25 NT Series 139 TB | 1'170'000 | AUD | 99.27168 % | 682'504.28 | 0.12 |
| AU3TB0000192 | 3 3/4 % Australia 14-37 Series 144 NT | 432'000 | AUD | 96.59829 % | 245'215.17 | 0.04 |
| Australie | | | | | 15'034'147.12 | 2.64 |
| AT0000A0U299 | 3.80 % Oesterreich 12-62 | 195'000 | EUR | 116.91348 % | 221'768.80 | 0.04 |
| AT0000A10683 | 2.40 % Oesterreich 13-34 | 816'000 | EUR | 96.40264 % | 765'209.43 | 0.13 |
| AT0000A1FAP5 | 1.20 % Oesterreich 15-25 | 1'980'000 | EUR | 97.16753 % | 1'871'490.25 | 0.34 |
| AT0000A1K9C8 | 3/4 % Oesterreich 16-26 | 450'000 | EUR | 95.07022 % | 416'158.01 | 0.07 |
| AT0000A1K9F1 | 1 1/2 % Oesterreich 16-47 | 492'000 | EUR | 75.27984 % | 360'284.04 | 0.06 |
| AT0000A1VGK0 | 1/2 % Oesterreich 17-27 | 304'000 | EUR | 93.49334 % | 276'474.77 | 0.05 |
| AT0000A2CQD2 | 0 % Oesterreich 20-30 Series 1 | 1'000'000 | EUR | 85.70214 % | 833'667.53 | 0.15 |
| AT0000A2EJ08 | 3/4 % Oesterreich 20-51 | 550'000 | EUR | 59.25464 % | 317'019.71 | 0.06 |
| AT0000A2KQ43 | 0 % Oesterreich 20-40 NT | 400'000 | EUR | 61.60846 % | 239'718.52 | 0.04 |
| AT0000A2NW83 | 0 % Oesterreich 21-31 | 700'000 | EUR | 83.26136 % | 566'947.44 | 0.10 |
| AT0000A2WSC8 | 0.90 % Oesterreich 22-32 | 1'500'000 | EUR | 87.06576 % | 1'270'398.19 | 0.22 |
| AT0000A33SK7 | 3.15 % Oesterreich 23-53 | 600'000 | EUR | 101.89252 % | 594'695.69 | 0.10 |
| Autriche | | | | | 7'733'832.38 | 1.36 |
| BE0000320292 | 4 1/4 % Belgique 10-41 Unitary 60 OLO | 500'000 | EUR | 114.21102 % | 555'493.82 | 0.10 |
| BE0000326356 | 4 % Belgique 12-32 Unitary 66 OLO | 1'000'000 | EUR | 109.07814 % | 1'061'057.62 | 0.17 |
| BE0000335449 | 1 % Belgique 15-31 Unitary 75 OLO | 1'000'000 | EUR | 89.07914 % | 866'517.35 | 0.15 |
| BE0000337460 | 1 % Belgique 16-26 Unitary 77 OLO | 400'000 | EUR | 96.09823 % | 373'918.21 | 0.07 |
| BE0000338476 | 1.60 % Belgique 16-47 Unitary 78 OLO | 216'000 | EUR | 73.23834 % | 153'884.00 | 0.03 |
| BE0000341504 | 0.80 % Belgique 17-27 Unitary 81 OLO | 500'000 | EUR | 94.22487 % | 458'286.22 | 0.08 |
| BE0000343526 | 2 1/4 % Belgique 17-57 Unitary 83 OLO | 350'000 | EUR | 78.86165 % | 268'494.34 | 0.05 |
| BE0000348574 | 1.70 % Belgique 19-50 Unitary 88 OLO | 950'000 | EUR | 72.41371 % | 669'184.12 | 0.12 |
| BE0000349580 | 0.10 % Belgique 20-30 Unitary 89 OLO | 750'000 | EUR | 85.60008 % | 624'506.11 | 0.11 |
| BE0000354630 | 0.35 % Belgique 22-32 Unitary 94 OLO | 1'200'000 | EUR | 82.55775 % | 963'696.64 | 0.17 |
| Belgique | | | | | 5'995'038.43 | 1.05 |
| CA135087D358 | 2 3/4 % Canada 14-48 Series D 358 TB | 180'000 | CAD | 89.74714 % | 107'521.49 | 0.02 |
| CA135087F825 | 1 % Canada 16-27 Series F825 TB | 2'115'000 | CAD | 92.26892 % | 1'298'876.78 | 0.23 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|---------------------------|--|----------------|---------|-------------|----------------------|--------------|
| CA135087H722 | 2 % Canada 17-51 Series H722 TB | 1'880'000 | CAD | 75.66177 % | 946'752.54 | 0.17 |
| CA135087K940 | 1/2 % Canada 20-25 TB | 500'000 | CAD | 94.8532 % | 315'663.35 | 0.06 |
| CA135087L930 | 1 % Canada 21-26 TB | 3'800'000 | CAD | 93.37604 % | 2'361'680.90 | 0.42 |
| CA135087M276 | 1 1/2 % Canada 21-31 TB | 4'300'000 | CAD | 87.75234 % | 2'511'477.65 | 0.42 |
| CA135087M680 | 1 3/4 % Canada 21-53 TB | 800'000 | CAD | 70.29327 % | 374'287.96 | 0.07 |
| CA135087Q236 | 2 3/4 % Canada 23-33 TB | 2'060'000 | CAD | 94.53745 % | 1'296'203.71 | 0.23 |
| CA135087Q491 | 3 1/4 % Canada 23-28 TB | 1'300'000 | CAD | 98.79785 % | 854'856.04 | 0.15 |
| CA135087XG49 | 5 3/4 % Canada 01-33 Series XG49 TB | 900'000 | CAD | 117.57871 % | 704'325.43 | 0.12 |
| CA135087ZS68 | 3 1/2 % Canada 11-45 Series ZS68 TB | 730'000 | CAD | 101.60971 % | 493'696.71 | 0.09 |
| Canada | | | | | 11'265'342.56 | 1.98 |
| CND100014N5 | 3.91 % République Populaire de Chine 08-38 NT | 4'200'000 | CNY | 118.60681 % | 617'985.74 | 0.11 |
| CND10001L774 | 3.54 % République Populaire de Chine 18-28 NT | 8'000'000 | CNY | 106.23322 % | 1'054'313.72 | 0.19 |
| CND1000291L3 | 3.29 % République Populaire de Chine 19-29 NT | 10'000'000 | CNY | 105.40259 % | 1'307'587.64 | 0.23 |
| CND100029RW4 | 3 1/4 % République Populaire de Chine 19-26 NT | 15'000'000 | CNY | 102.90908 % | 1'914'981.10 | 0.34 |
| CND10002D1Y9 | 3.86 % République Populaire de Chine 19-49 NT | 16'500'000 | CNY | 122.87431 % | 2'515'153.88 | 0.44 |
| CND10002HGP5 | 2.94 % République Populaire de Chine 19-24 NT | 22'000'000 | CNY | 100.66814 % | 2'747'478.08 | 0.48 |
| CND10002M200 | 3.39 % République Populaire de Chine 20-50 NT | 17'000'000 | CNY | 114.31715 % | 2'410'903.54 | 0.42 |
| CND100031JZ0 | 1.99 % République Populaire de Chine 20-25 NT | 8'000'000 | CNY | 100.15587 % | 993'998.89 | 0.17 |
| CND100036Q75 | 2.68 % République Populaire de Chine 20-30 NT | 11'000'000 | CNY | 102.00724 % | 1'392'012.75 | 0.24 |
| CND100037XX3 | 2.85 % République Populaire de Chine 20-27 NT | 42'000'000 | CNY | 102.34911 % | 5'332'770.54 | 0.94 |
| CND100039ZX4 | 2.77 % République Populaire de Chine 20-30 NT | 2'000'000 | CNY | 102.58884 % | 254'536.26 | 0.04 |
| CND10003N750 | 3.81 % République Populaire de Chine 20-50 NT | 15'000'000 | CNY | 122.70165 % | 2'283'290.57 | 0.40 |
| CND10003R702 | 3.02 % République Populaire de Chine 20-25 NT | 31'000'000 | CNY | 101.76592 % | 3'913'664.55 | 0.69 |
| CND100045210 | 3.03 % République Populaire de Chine 21-26 NT | 6'000'000 | CNY | 102.09515 % | 759'934.04 | 0.13 |
| CND10004LLJ6 | 2.47 % République Populaire de Chine 21-24 NT | 22'500'000 | CNY | 100.33635 % | 2'800'659.72 | 0.49 |
| CND10004NCM5 | 3.53 % République Populaire de Chine 21-51 NT | 18'600'000 | CNY | 118.00674 % | 2'722'947.66 | 0.48 |
| CND10004TCP5 | 3.32 % République Populaire de Chine 22-52 NT | 16'100'000 | CNY | 114.09751 % | 2'278'880.48 | 0.40 |
| CND10005F4L5 | 2 1/2 % République Populaire de Chine 22-27 NT | 44'000'000 | CNY | 101.11358 % | 5'519'270.61 | 0.97 |
| CND10005L4G7 | 2.60 % République Populaire de Chine 22-32 NT | 75'000'000 | CNY | 101.63757 % | 9'456'601.18 | 1.69 |
| CND10005QTD8 | 2.44 % République Populaire de Chine 22-27 NT | 40'000'000 | CNY | 100.9016 % | 5'006'999.89 | 0.88 |
| CND100069PK9 | 3.19 % République Populaire de Chine 23-53 NT | 15'000'000 | CNY | 113.9913 % | 2'121'204.29 | 0.37 |
| CND10006GPT1 | 2.67 % République Populaire de Chine 23-33 NT | 28'000'000 | CNY | 102.32903 % | 3'554'482.80 | 0.62 |
| CND10006PJH0 | 2.40 % République Populaire de Chine 23-28 NT | 7'000'000 | CNY | 100.80902 % | 875'420.98 | 0.15 |
| CND10007C5P4 | 2.37 % République Populaire de Chine 24-29 NT | 26'000'000 | CNY | 100.85649 % | 3'253'094.91 | 0.57 |
| Chine | | | | | 65'088'173.82 | 11.44 |
| CZ0001002547 | 5.70 % Czech Republic 09-24 Series 58 | 4'000'000 | CZK | 99.9598 % | 153'818.54 | 0.03 |
| CZ0001003859 | 2 1/2 % Czech Republic 13-28 Series 78 | 30'120'000 | CZK | 95.10294 % | 1'101'976.26 | 0.19 |
| CZ0001004477 | 0.95 % Czech Republic 15-30 Series 94 | 21'000'000 | CZK | 84.67021 % | 684'026.99 | 0.12 |
| CZ0001005243 | 2 % Czech Republic 17-33 Series 103 | 17'700'000 | CZK | 84.7909 % | 577'358.83 | 0.10 |
| CZ0001005888 | 1.20 % Czech Republic 20-31 Series 121 | 15'000'000 | CZK | 84.24938 % | 486'162.31 | 0.09 |
| CZ0001005920 | 1 1/2 % Czech Republic 20-40 Series 125 | 5'000'000 | CZK | 70.24821 % | 135'122.78 | 0.02 |
| République tchèque | | | | | 3'138'465.71 | 0.55 |
| DE0001102374 | 1/2 % Deutschland 15-25 | 380'000 | EUR | 97.57691 % | 360'688.16 | 0.06 |
| DE0001102390 | 1/2 % Deutschland 16-26 | 9'800'000 | EUR | 95.83179 % | 9'135'596.53 | 1.61 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|------------------|---------------------------|----------------|---------|-------------|----------------------|-------------|
| DE0001102416 | 1/4 % Deutschland 17-27 | 6'000'000 | EUR | 93.77326 % | 5'473'076.03 | 0.96 |
| DE0001102432 | 1 1/4 % Deutschland 17-48 | 780'000 | EUR | 78.22069 % | 593'495.59 | 0.10 |
| DE0001102440 | 1/2 % Deutschland 18-28 | 8'300'000 | EUR | 93.16989 % | 7'522'373.63 | 1.32 |
| DE0001102481 | 0 % Deutschland 19-50 | 49'950 | EUR | 53.36057 % | 25'927.29 | 0.00 |
| DE0001102523 | 0 % Deutschland 20-27 | 5'000'000 | EUR | 91.7292 % | 4'461'478.87 | 0.78 |
| DE0001102549 | 0 % Deutschland 21-36 | 1'000'000 | EUR | 75.24401 % | 731'936.10 | 0.13 |
| DE0001102614 | 1.80 % Deutschland 22-53 | 3'900'000 | EUR | 86.5918 % | 3'285'054.88 | 0.58 |
| DE0001135366 | 4 3/4 % Deutschland 08-40 | 1'200'000 | EUR | 130.34957 % | 1'521'570.47 | 0.27 |
| DE0001135432 | 3 1/4 % Deutschland 10-42 | 4'000'000 | EUR | 111.23619 % | 4'328'200.27 | 0.76 |
| DE0001135481 | 2 1/2 % Deutschland 12-44 | 849'000 | EUR | 100.24411 % | 827'880.81 | 0.15 |
| DE000BU27006 | 2.40 % Deutschland 23-30 | 1'000'000 | EUR | 100.80703 % | 980'600.41 | 0.17 |
| DE000BU2D004 | 2 1/2 % Deutschland 24-54 | 3'000'000 | EUR | 101.02381 % | 2'948'127.19 | 0.52 |
| DE000BU2Z007 | 2.30 % Deutschland 23-33 | 10'000'000 | EUR | 100.36237 % | 9'762'749.25 | 1.72 |
| DE000BU2Z015 | 2.60 % Deutschland 23-33 | 1'000'000 | EUR | 102.71995 % | 999'208.34 | 0.18 |
| Allemagne | | | | | 52'957'963.82 | 9.31 |
| DK0009922320 | 4 1/2 % Denmark 07-39 TB | 7'000'000 | DKK | 125.76431 % | 1'148'094.63 | 0.20 |
| DK0009923567 | 1/2 % Denmark 17-27 TB | 7'100'000 | DKK | 93.61512 % | 866'815.33 | 0.15 |
| DK0009923807 | 1/2 % Denmark 19-29 TB | 5'200'000 | DKK | 90.87968 % | 616'300.24 | 0.11 |
| DK0009924029 | 1/4 % Denmark 20-52 TB | 2'000'000 | DKK | 55.85 % | 145'671.75 | 0.03 |
| DK0009924532 | 2 1/4 % Denmark 23-33 TB | 1'200'000 | DKK | 99.35735 % | 155'490.36 | 0.03 |
| Danemark | | | | | 2'932'372.31 | 0.52 |
| ES00000121S7 | 4.70 % Espana 09-41 BS | 1'600'000 | EUR | 115.18466 % | 1'792'734.10 | 0.32 |
| ES00000124H4 | 5.15 % Espana 13-44 BS | 486'000 | EUR | 122.41279 % | 578'714.43 | 0.10 |
| ES00000126Z1 | 1.60 % Espana 15-25 BS | 2'500'000 | EUR | 98.18228 % | 2'387'670.23 | 0.42 |
| ES00000127A2 | 1.95 % Espana 15-30 BS | 3'300'000 | EUR | 94.81756 % | 3'043'714.79 | 0.52 |
| ES00000128C6 | 2.90 % Espana 16-46 BS | 1'020'000 | EUR | 89.17401 % | 884'789.00 | 0.16 |
| ES00000128P8 | 1 1/2 % Espana 17-27 BS | 2'800'000 | EUR | 96.03373 % | 2'615'670.78 | 0.46 |
| ES0000012932 | 4.20 % Espana 05-37 BS | 1'800'000 | EUR | 109.22748 % | 1'912'518.51 | 0.34 |
| ES0000012E51 | 1.45 % Espana 19-29 BS | 2'900'000 | EUR | 93.68352 % | 2'642'788.56 | 0.46 |
| ES0000012F43 | 0.60 % Espana 19-29 BS | 1'100'000 | EUR | 88.65367 % | 948'616.39 | 0.17 |
| ES0000012G00 | 1 % Espana 20-50 BS | 830'000 | EUR | 55.59068 % | 448'829.39 | 0.08 |
| ES0000012I32 | 1/2 % Espana 21-31 BS | 2'600'000 | EUR | 83.65946 % | 2'115'873.31 | 0.37 |
| ES0000012K46 | 1.90 % Espana 22-52 BS | 600'000 | EUR | 68.68772 % | 400'895.86 | 0.07 |
| ES0000012K61 | 2.55 % Espana 22-32 BS | 2'700'000 | EUR | 96.52919 % | 2'535'266.67 | 0.45 |
| Espagne | | | | | 22'308'082.02 | 3.92 |
| FI4000037635 | 2 3/4 % Finland 12-28 TB | 633'000 | EUR | 100.34626 % | 617'882.84 | 0.11 |
| FI4000046545 | 2 5/8 % Finland 12-42 TB | 220'000 | EUR | 95.09988 % | 203'518.49 | 0.04 |
| FI4000148630 | 3/4 % Finland 15-31 TB | 1'900'000 | EUR | 87.84443 % | 1'623'562.72 | 0.29 |
| FI4000167317 | 7/8 % Finland 15-25 TB | 500'000 | EUR | 96.93852 % | 471'484.75 | 0.08 |
| FI4000242870 | 1 3/8 % Finland 17-47 TB | 240'000 | EUR | 73.97384 % | 172'699.33 | 0.03 |
| FI4000440557 | 1/4 % Finland 20-40 TB | 200'000 | EUR | 64.93674 % | 126'334.43 | 0.02 |
| FI4000480488 | 1/8 % Finland 21-52 TB | 300'000 | EUR | 47.86398 % | 139'679.05 | 0.02 |
| Finlande | | | | | 3'355'161.61 | 0.59 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|------------------------|---------------------------------------|----------------|---------|-------------|----------------------|-------------|
| FR0000187635 | 5 3/4 % France 01-32 OAT | 7'200'000 | EUR | 122.51915 % | 8'580'996.51 | 1.51 |
| FR0010773192 | 4 1/2 % France 09-41 OAT | 700'000 | EUR | 118.50889 % | 806'956.67 | 0.14 |
| FR0010870956 | 4 % France 10-60 OAT | 350'000 | EUR | 115.69945 % | 393'913.22 | 0.07 |
| FR0010916924 | 3 1/2 % France 10-26 OAT | 1'395'000 | EUR | 101.2161 % | 1'373'488.54 | 0.24 |
| FR0011461037 | 3 1/4 % France 13-45 OAT | 820'000 | EUR | 101.07993 % | 806'269.10 | 0.14 |
| FR0011962398 | 1 3/4 % France 14-24 OAT | 132'000 | EUR | 98.8083 % | 126'872.81 | 0.02 |
| FR0012938116 | 1 % France 15-25 OAT | 3'300'000 | EUR | 96.7663 % | 3'106'270.80 | 0.55 |
| FR0012993103 | 1 1/2 % France 15-31 OAT | 5'100'000 | EUR | 92.62827 % | 4'595'311.73 | 0.81 |
| FR0013154044 | 1 1/4 % France 15-36 OAT | 400'000 | EUR | 82.99091 % | 322'917.63 | 0.06 |
| FR0013250560 | 1 % France 17-27 OAT | 2'000'000 | EUR | 94.89203 % | 1'846'124.52 | 0.32 |
| FR0013257524 | 2 % France 17-48 OAT | 1'350'000 | EUR | 79.95304 % | 1'049'953.32 | 0.18 |
| FR0013286192 | 3/4 % France 17-28 OAT | 900'000 | EUR | 92.64128 % | 811'051.25 | 0.14 |
| FR0013407236 | 1/2 % France 18-29 OAT | 2'000'000 | EUR | 89.89068 % | 1'748'823.10 | 0.31 |
| FR0013480613 | 3/4 % France 19-52 OAT | 2'840'000 | EUR | 55.01668 % | 1'519'896.30 | 0.27 |
| FR0013516549 | 0 % France 19-30 OAT | 600'000 | EUR | 84.12897 % | 491'018.75 | 0.09 |
| FR001400CMX2 | 2 1/2 % France 22-43 OAT | 1'400'000 | EUR | 90.28442 % | 1'229'538.34 | 0.22 |
| France | | | | | 28'809'402.59 | 5.07 |
| GB0032452392 | 4 1/4 % United Kingdom 03-36 TB | 1'150'000 | GBP | 102.12769 % | 1'336'310.15 | 0.23 |
| GB00B1VWPJ53 | 4 1/2 % United Kingdom 07-42 TB | 1'700'000 | GBP | 102.08463 % | 1'974'582.20 | 0.35 |
| GB00B24FF097 | 4 3/4 % United Kingdom 07-30 TB | 3'600'000 | GBP | 105.83553 % | 4'335'107.97 | 0.76 |
| GB00B3KJDS62 | 4 1/4 % United Kingdom 09-39 TB | 1'552'000 | GBP | 100.17278 % | 1'768'916.58 | 0.31 |
| GB00B6RNH572 | 3 3/4 % United Kingdom 11-52 TB | 2'100'000 | GBP | 89.63511 % | 2'141'723.35 | 0.38 |
| GB00BDRHNP05 | 1 1/4 % United Kingdom 17-27 TB | 1'400'000 | GBP | 91.81849 % | 1'462'595.12 | 0.26 |
| GB00BFWFPP71 | 1 3/4 % United Kingdom 18-49 TB | 3'000'000 | GBP | 60.46677 % | 2'063'972.80 | 0.36 |
| GB00BFX0ZL78 | 1 5/8 % United Kingdom 18-28 TB | 1'200'000 | GBP | 91.1106 % | 1'243'987.72 | 0.22 |
| GB00BL68HJ26 | 1/8 % United Kingdom 20-26 TB | 3'300'000 | GBP | 92.98399 % | 3'491'307.21 | 0.61 |
| GB00BLH38158 | 1 1/4 % United Kingdom 21-51 TB | 2'200'000 | GBP | 50.55181 % | 1'265'392.67 | 0.22 |
| GB00BMGR2809 | 1/4 % United Kingdom 20-31 TB | 500'000 | GBP | 77.56776 % | 441'282.98 | 0.08 |
| GB00BPCJD997 | 3 3/4 % United Kingdom 23-53 TB | 14'850'000 | GBP | 89.25116 % | 15'080'171.20 | 2.66 |
| GB00BPJJKN53 | 4 5/8 % United Kingdom 23-34 TB | 3'900'000 | GBP | 105.67824 % | 4'689'387.54 | 0.82 |
| Grande-Bretagne | | | | | 41'294'737.49 | 7.26 |
| GR0124040743 | 3 3/8 % Grèce 24-34 | 1'000'000 | EUR | 99.94481 % | 972'213.17 | 0.17 |
| Grèce | | | | | 972'213.17 | 0.17 |
| HU0000403118 | 3 % Hungary 16-27 Series A | 306'580'000 | HUF | 88.5648 % | 670'306.27 | 0.11 |
| HU0000403696 | 3 % Hungary 19-30 Series A | 160'000'000 | HUF | 81.2928 % | 321'100.05 | 0.06 |
| Hongrie | | | | | 991'406.32 | 0.17 |
| IDG000010307 | 6 1/8 % Indonesia 12-28 Series FR0064 | 8'980'000'000 | IDR | 98.49394 % | 502'382.15 | 0.09 |
| Indonésie | | | | | 502'382.15 | 0.09 |
| IE00BH3SQ895 | 1.10 % Ireland 19-29 TB | 1'514'000 | EUR | 93.11984 % | 1'371'416.31 | 0.24 |
| IE00BH3SQB22 | 1 1/2 % Ireland 19-50 TB | 300'000 | EUR | 73.17161 % | 213'533.05 | 0.04 |
| IE00BJ38CR43 | 2.40 % Ireland 14-30 TB | 461'000 | EUR | 99.12874 % | 444'530.70 | 0.08 |
| IE00BMD03L28 | 0.35 % Ireland 21-32 TB | 1'000'000 | EUR | 82.95305 % | 806'925.75 | 0.14 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|----------------|----------------------------------|----------------|---------|-------------|----------------------|-------------|
| IE00BMQ5JL65 | 0 % Ireland 21-31 TB | 750'000 | EUR | 82.52098 % | 602'042.09 | 0.11 |
| IE00BMQ5JM72 | 0.55 % Ireland 21-41 TB | 700'000 | EUR | 68.27142 % | 464'877.20 | 0.08 |
| IE00BV8C9186 | 2 % Ireland 15-45 TB | 400'000 | EUR | 85.13906 % | 331'276.09 | 0.06 |
| IE00BV8C9418 | 1 % Ireland 16-26 TB | 500'000 | EUR | 96.32739 % | 468'512.35 | 0.08 |
| IE00BV8C9B83 | 1.70 % Ireland 17-37 TB | 400'000 | EUR | 87.55386 % | 340'672.06 | 0.06 |
| Irlande | | | | | 5'043'785.60 | 0.89 |
| IL0011254005 | 5 1/2 % Israel 12-42 | 800'000 | ILS | 109.40695 % | 215'176.69 | 0.04 |
| IL0011393449 | 2 % Israel 16-27 | 800'000 | ILS | 94.36573 % | 185'594.28 | 0.03 |
| IL0011401937 | 3 3/4 % Israel 17-47 | 2'100'000 | ILS | 85.21102 % | 439'921.69 | 0.08 |
| IL0011508798 | 2 1/4 % Israel 18-28 Classe SHA | 1'300'000 | ILS | 92.61262 % | 295'987.81 | 0.05 |
| IL0011806606 | 1.30 % Israel 21-32 | 2'900'000 | ILS | 79.77571 % | 568'759.96 | 0.10 |
| Israël | | | | | 1'705'440.43 | 0.30 |
| IT0005162828 | 2.70 % Italia 16-47 BT | 2'100'000 | EUR | 80.18329 % | 1'637'964.16 | 0.29 |
| IT0005390874 | 0.85 % Italia 19-27 BT | 3'000'000 | EUR | 94.00159 % | 2'743'201.37 | 0.48 |
| IT0005421703 | 1.80 % Italia 20-41 BT | 1'800'000 | EUR | 73.33066 % | 1'283'983.16 | 0.23 |
| IT0005425233 | 1.70 % Italia 20-51 BT | 1'200'000 | EUR | 62.42123 % | 728'642.99 | 0.13 |
| IT0005433690 | 1/4 % Italia 21-28 BT | 6'000'000 | EUR | 89.44444 % | 5'220'424.45 | 0.92 |
| IT0005466013 | 0.95 % Italia 21-32 BT | 11'000'000 | EUR | 82.49231 % | 8'826'883.29 | 1.54 |
| Italie | | | | | 20'441'099.42 | 3.59 |
| JP1103361EC6 | 1/2 % Japan 14-24 No 336 | 1'850'000 | JPY | 100.33162 % | 11'046.42 | 0.00 |
| JP1103541K42 | 0.10 % Japan 19-29 No 354 | 400'000'000 | JPY | 98.7028 % | 2'349'639.90 | 0.41 |
| JP1103631M74 | 0.10 % Japan 21-31 Series 363 TB | 490'000'000 | JPY | 97.20728 % | 2'834'697.49 | 0.50 |
| JP1103701P43 | 1/2 % Japan 23-33 Series 370 TB | 1'650'000'000 | JPY | 98.76633 % | 9'698'502.60 | 1.71 |
| JP1201131990 | 2.10 % Japan 09-29 No 113 | 630'000'000 | JPY | 109.31298 % | 4'098'492.40 | 0.72 |
| JP1201231AC0 | 2.10 % Japan 10-30 No 123 | 400'000'000 | JPY | 110.88974 % | 2'639'752.37 | 0.46 |
| JP1201411CC4 | 1.70 % Japan 12-32 No 141 | 830'000'000 | JPY | 109.15573 % | 5'391'833.42 | 0.95 |
| JP1201501E99 | 1.40 % Japan 14-34 No 150 | 150'000'000 | JPY | 106.16652 % | 947'743.25 | 0.17 |
| JP1201511EC7 | 1.20 % Japan 14-34 No 151 | 173'000'000 | JPY | 104.03579 % | 1'071'126.37 | 0.19 |
| JP1201561G37 | 0.40 % Japan 16-36 No 156 | 280'000'000 | JPY | 94.53666 % | 1'575'324.78 | 0.28 |
| JP1201611H69 | 0.60 % Japan 17-37 No 161 | 250'000'000 | JPY | 95.03153 % | 1'413'902.78 | 0.25 |
| JP1201741LA9 | 0.40 % Japan 20-40 Series 174 TB | 100'000'000 | JPY | 87.08146 % | 518'247.90 | 0.09 |
| JP1201751M13 | 1/2 % Japan 20-40 Series 175 TB | 80'000'000 | JPY | 88.19022 % | 419'877.15 | 0.07 |
| JP1201781MA3 | 1/2 % Japan 21-41 No 178 | 101'000'000 | JPY | 86.88723 % | 522'262.91 | 0.09 |
| JP1201851P76 | 1.10 % Japan 23-43 Series 185 TB | 220'000'000 | JPY | 94.28806 % | 1'234'500.36 | 0.22 |
| JP1300371C98 | 1.90 % Japan 12-42 No 37 | 799'950'000 | JPY | 108.17336 % | 5'149'855.10 | 0.91 |
| JP1300461F39 | 1 1/2 % Japan 15-45 No 46 | 450'000'000 | JPY | 99.48951 % | 2'664'413.56 | 0.47 |
| JP1300551H61 | 0.80 % Japan 17-47 No 55 | 150'000'000 | JPY | 84.64932 % | 755'660.24 | 0.13 |
| JP1300641KA3 | 0.40 % Japan 19-49 No 64 | 340'000'000 | JPY | 73.71193 % | 1'491'518.05 | 0.26 |
| JP1300691M16 | 0.70 % Japan 20-50 Series 69 TB | 105'000'000 | JPY | 78.45298 % | 490'242.07 | 0.09 |
| JP1300711M79 | 0.70 % Japan 21-51 Series 71 TB | 60'000'000 | JPY | 77.91743 % | 278'226.01 | 0.05 |
| JP1300801PA2 | 1.80 % Japan 23-53 Series 80 TB | 280'000'000 | JPY | 100.58588 % | 1'676'126.92 | 0.29 |
| JP1400051C51 | 2 % Japan 12-52 Series 5 TB | 480'000'000 | JPY | 105.80218 % | 3'022'370.44 | 0.53 |
| JP1400081F45 | 1.40 % Japan 15-55 No 8 | 210'000'000 | JPY | 90.79626 % | 1'134'747.14 | 0.20 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|-------------------------|--|----------------|---------|-------------|----------------------|-------------|
| JP1400161P53 | 1.3 % Japan 23-63 Series 16 TB | 200'000'000 | JPY | 83.24212 % | 990'797.65 | 0.17 |
| Japon | | | | | 52'380'907.28 | 9.21 |
| LU1556942974 | 5/8 % Luxembourg 17-27 | 33'000 | EUR | 93.78202 % | 30'104.74 | 0.01 |
| Luxembourg | | | | | 30'104.74 | 0.01 |
| MX0MGO000078 | 10 % Mexico 05-24 Series M BS | 20'000 | MXN | 99.35212 % | 107'673.85 | 0.02 |
| MX0MGO0000H9 | 8 1/2 % Mexico 09-29 BS | 80'000 | MXN | 96.97424 % | 420'387.21 | 0.07 |
| MX0MGO0000J5 | 8 1/2 % Mexico 09-38 BS | 90'000 | MXN | 93.31388 % | 455'084.32 | 0.08 |
| MX0MGO0000P2 | 7 3/4 % Mexico 11-31 BS | 1'469'000 | MXN | 92.18088 % | 7'337'797.94 | 1.29 |
| MX0MGO0000R8 | 7 3/4 % Mexico 11-42 BS | 21'000 | MXN | 85.229 % | 96'986.18 | 0.02 |
| MX0MGO000102 | 8 % Mexico 17-47 BS | 41'000 | MXN | 86.56887 % | 192'330.75 | 0.03 |
| Mexique | | | | | 8'610'260.25 | 1.51 |
| MYBMO1700040 | 3.899 % Malaysia 17-27 Series 17/0004 NT | 4'300'000 | MYR | 101.22479 % | 828'321.47 | 0.15 |
| Malaisie | | | | | 828'321.47 | 0.15 |
| NL0000102234 | 4 % Niederlande 05-37 | 1'200'000 | EUR | 114.4815 % | 1'336'342.58 | 0.23 |
| NL0009446418 | 3 3/4 % Niederlande 10-42 | 1'076'000 | EUR | 114.90917 % | 1'202'730.15 | 0.21 |
| NL0010071189 | 2 1/2 % Niederlande 12-33 | 1'800'000 | EUR | 99.81137 % | 1'747'647.11 | 0.31 |
| NL0010721999 | 2 3/4 % Niederlande 14-47 | 1'200'000 | EUR | 101.6469 % | 1'186'524.26 | 0.21 |
| NL0011819040 | 1/2 % Niederlande 16-26 | 1'500'000 | EUR | 95.11125 % | 1'387'792.02 | 0.24 |
| NL0012171458 | 3/4 % Niederlande 17-27 | 2'200'000 | EUR | 94.35741 % | 2'019'295.83 | 0.36 |
| NL0012818504 | 3/4 % Niederlande 18-28 Unitary 1444A | 1'800'000 | EUR | 92.95179 % | 1'627'539.42 | 0.29 |
| NL0015000RP1 | 1/2 % Niederlande 20-32 | 750'000 | EUR | 85.05228 % | 620'509.56 | 0.11 |
| NL0015614579 | 0 % Niederlande 20-52 | 1'000'000 | EUR | 49.47942 % | 481'311.10 | 0.08 |
| Pays-Bas | | | | | 11'609'692.03 | 2.04 |
| NO0010786288 | 1 3/4 % Norway 17-27 TB | 4'431'000 | NOK | 94.86083 % | 348'975.51 | 0.06 |
| NO0010875230 | 1 3/8 % Norway 20-30 TB | 19'100'000 | NOK | 87.96545 % | 1'394'927.90 | 0.25 |
| Norvège | | | | | 1'743'903.41 | 0.31 |
| NZGOVDT427C1 | 4 1/2 % New Zealand 14-27 NT | 720'000 | NZD | 100.20708 % | 388'705.91 | 0.07 |
| NZGOVDT433C9 | 3 1/2 % New Zealand 15-33 NT | 1'130'000 | NZD | 92.28426 % | 561'818.91 | 0.10 |
| NZGOVDT541C9 | 1 3/4 % New Zealand 20-41 NT | 1'200'000 | NZD | 63.96314 % | 413'524.52 | 0.07 |
| Nouvelle-Zélande | | | | | 1'364'049.34 | 0.24 |
| PL0000109427 | 2 1/2 % Poland 16-27 Series DS0727 | 6'800'000 | PLN | 92.12342 % | 1'414'917.72 | 0.25 |
| PL0000112736 | 1 1/4 % Poland 20-30 Series DS1030 | 6'400'000 | PLN | 77.98171 % | 1'127'262.21 | 0.20 |
| PL0000115291 | 6 % Poland 22-33 Series DS1033 | 4'800'000 | PLN | 104.25 % | 1'130'236.96 | 0.20 |
| Pologne | | | | | 3'672'416.89 | 0.65 |
| PTOTECOE0037 | 1 % Republique Portugaise 21-52 BT | 200'000 | EUR | 56.83331 % | 110'569.20 | 0.02 |
| PTOTENOE0034 | 0.90 % Republique Portugaise 20-35 BT | 470'000 | EUR | 79.46361 % | 363'301.65 | 0.06 |
| PTOTE0OE0033 | 0.30 % Republique Portugaise 21-31 BT | 1'700'000 | EUR | 83.91038 % | 1'387'604.92 | 0.24 |
| PTOTEPOE0032 | 1.15 % Republique Portugaise 22-42 BT | 300'000 | EUR | 70.98755 % | 207'159.43 | 0.04 |
| PTOTEUOE0019 | 4 1/8 % Republique Portugaise 17-27 BT | 155'000 | EUR | 104.55066 % | 157'637.57 | 0.03 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|------------------|--|----------------|---------|-------------|---------------------|-------------|
| PTOTEV0E0018 | 2 1/8 % Republique Portugaise 18-28 BT | 2'500'000 | EUR | 98.43116 % | 2'393'722.65 | 0.42 |
| Portugal | | | | | 4'619'995.42 | 0.81 |
| SG3254976487 | 2 3/4 % Singapore 12-42 NT TB | 400'000 | SGD | 96.08015 % | 256'488.98 | 0.05 |
| SG3261987691 | 3 3/8 % Singapore 13-33 TB | 1'000'000 | SGD | 102.22067 % | 682'203.28 | 0.11 |
| SG7J60932174 | 3 1/2 % Singapore 07-27 | 763'000 | SGD | 100.88041 % | 513'696.30 | 0.09 |
| SG7S30941627 | 3 % Singapore 09-24 | 510'000 | SGD | 99.62835 % | 339'100.33 | 0.06 |
| SG7U32949426 | 2 7/8 % Singapore 10-30 NT TB | 560'000 | SGD | 98.73904 % | 369'021.78 | 0.06 |
| SGXF27246101 | 1 7/8 % Singapore 20-50 TB | 600'000 | SGD | 79.74443 % | 319'320.40 | 0.06 |
| SGXF46767848 | 2 5/8 % Singapore 22-32 TB | 250'000 | SGD | 96.57151 % | 161'125.43 | 0.03 |
| Singapour | | | | | 2'640'956.50 | 0.46 |
| SK4120008871 | 3 3/8 % Slovakia 12-24 Series 223 | 300'000 | EUR | 99.686 % | 290'908.68 | 0.05 |
| SK4120010430 | 1 3/8 % Slovakia 15-27 Series 228 | 82'000 | EUR | 95.11841 % | 75'871.67 | 0.01 |
| SK4120011420 | 1 5/8 % Slovakia 16-31 Series 229 | 200'000 | EUR | 89.8599 % | 174'822.44 | 0.03 |
| SK4120014184 | 2 1/4 % Slovakia 18-68 | 27'000 | EUR | 68.93201 % | 18'104.47 | 0.00 |
| SK4120015173 | 3/4 % Slovakia 19-30 Series 236 | 700'000 | EUR | 86.93105 % | 591'935.27 | 0.11 |
| Slovaquie | | | | | 1'151'642.53 | 0.20 |
| SI0002103487 | 1 1/2 % Slovenija 15-35 | 100'000 | EUR | 85.33997 % | 83'014.45 | 0.01 |
| SI0002103677 | 1 3/4 % Slovenija 16-40 | 100'000 | EUR | 81.34587 % | 79'129.19 | 0.01 |
| SI0002103685 | 1 1/4 % Slovenija 17-27 | 249'000 | EUR | 95.56408 % | 231'470.29 | 0.04 |
| SI0002104196 | 1/8 % Slovenija 21-31 | 300'000 | EUR | 82.30647 % | 240'190.85 | 0.05 |
| Slovénie | | | | | 633'804.78 | 0.11 |
| SE0004517290 | 2 1/4 % Sverige 12-32 Series 1056 TB | 17'000'000 | SEK | 99.25093 % | 1'421'281.85 | 0.25 |
| SE0009496367 | 3/4 % Sverige 28 17-28 Series 1060 TB | 47'000'000 | SEK | 93.43387 % | 3'699'124.01 | 0.65 |
| SE0013935319 | 1/8 % Sverige 20-31 Series 1062 TB | 7'500'000 | SEK | 85.7078 % | 541'474.87 | 0.10 |
| Suède | | | | | 5'661'880.73 | 1.00 |
| TH0623031602 | 3.30 % Thailand 18-38 NT | 7'000'000 | THB | 106.35703 % | 183'781.11 | 0.03 |
| TH062303Q605 | 2 7/8 % Thailand 16-46 NT | 22'000'000 | THB | 96.81397 % | 525'771.90 | 0.09 |
| TH0623A3B608 | 3.65 % Thailand 10-31 NT | 68'500'000 | THB | 108.46885 % | 1'834'139.05 | 0.33 |
| Thaïlande | | | | | 2'543'692.06 | 0.45 |
| US912810PW27 | 4 3/8 % USA 08-38 TB | 3'156'000 | USD | 101.9375 % | 2'897'684.75 | 0.51 |
| US912810QS06 | 3 3/4 % USA 11-41 TB | 3'750'000 | USD | 92.07813 % | 3'110'053.78 | 0.55 |
| US912810QW18 | 3 % USA 12-42 TB | 3'750'000 | USD | 81.875 % | 2'765'430.47 | 0.49 |
| US912810RM27 | 3 % USA 15-45 TB | 2'800'000 | USD | 79.76563 % | 2'011'657.16 | 0.35 |
| US912810RV26 | 3 % USA 17-47 TB | 4'700'000 | USD | 78.67188 % | 3'330'408.61 | 0.59 |
| US912810SN90 | 1 1/4 % USA 20-50 TB | 1'900'000 | USD | 51.1875 % | 875'987.04 | 0.15 |
| US912810SQ22 | 1 1/8 % USA 20-40 TB | 1'850'000 | USD | 61.89063 % | 1'031'280.40 | 0.18 |
| US912810SX72 | 2 3/8 % USA 21-51 TB | 750'000 | USD | 67.9375 % | 458'934.79 | 0.08 |
| US912810TF57 | 2 3/8 % USA 22-42 TB | 1'700'000 | USD | 74.40625 % | 1'139'301.06 | 0.20 |
| US912810TV08 | 4 3/4 % USA 23-53 TB | 7'100'000 | USD | 106.8125 % | 6'830'627.33 | 1.20 |
| US912810TX63 | 4 1/4 % USA 24-54 Series 2054 TB | 800'000 | USD | 98.42188 % | 709'188.66 | 0.12 |
| US9128282A70 | 1 1/2 % USA 26 16-26 Series E-2026 TB | 9'800'000 | USD | 93.17969 % | 8'224'840.61 | 1.45 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|--------------|------------------------------------|----------------|---------|------------|---------------|------|
| US912828X885 | 2 3/8 % USA 17-27 Series C-2027 TB | 19'000'000 | USD | 94.10938 % | 16'105'219.67 | 2.83 |
| US91282CAU53 | 1/2 % USA 20-27 Series R-2027 TB | 14'300'000 | USD | 87.34375 % | 11'249'883.73 | 1.98 |
| US91282CCE93 | 1 1/4 % USA 21-28 Series L-2028 TB | 24'600'000 | USD | 88.48438 % | 19'605'677.63 | 3.45 |
| US91282CDW82 | 1 3/4 % USA 22-29 Series G-2029 TB | 9'000'000 | USD | 89.20313 % | 7'231'072.92 | 1.27 |
| US91282CFV81 | 4 1/8 % USA 22-32 TB | 4'500'000 | USD | 99.35938 % | 4'027'184.51 | 0.71 |
| US91282CGM73 | 3 1/2 % USA 23-33 TB | 8'000'000 | USD | 94.75 % | 6'827'306.00 | 1.20 |

Etats-Unis **98'431'739.12 17.31**

Instruments financiers dérivés **0.00 0.00**

| | | | | | | |
|--------------|----------------------|------|-----|-----------|-------|------|
| CBOT.TN50624 | US T-NOTES 5 Y | 410 | USD | 107.01563 | 0.00* | 0.00 |
| CBOT.UL10624 | US ULTRABOND 10 YEAR | -200 | USD | 114.60938 | 0.00* | 0.00 |
| CBOT.ULT0624 | US ULTRABOND 30 YEAR | -85 | USD | 129.00 | 0.00* | 0.00 |
| EURO.SH0624 | EURO SCHATZ EUREX | 810 | EUR | 105.70 | 0.00* | 0.00 |
| EURX.BD30624 | EUREX EURO BUND 30 Y | -95 | EUR | 135.80 | 0.00* | 0.00 |
| EURX.BOB0624 | EURO-BOBL | -300 | EUR | 118.25 | 0.00* | 0.00 |
| LIF.LG0624 | LONG GILT | 150 | GBP | 99.94 | 0.00* | 0.00 |

Futures **0.00* 0.00**

Valeurs mobilières non cotées en bourse

Obligations **43'532'392.40 7.65**

| | | | | | | |
|--------------|---------------------------------------|----------------|-----|-------------|--------------|------|
| IDG000009705 | 8 1/4 % Indonesia 11-32 Series FR0058 | 20'000'000'000 | IDR | 109.83672 % | 1'247'745.09 | 0.22 |
| IDG000012303 | 7 1/2 % Indonesia 17-38 Series FR0075 | 9'000'000'000 | IDR | 105.58891 % | 539'770.51 | 0.09 |
| IDG000012907 | 8.25 % Indonesia 18-29 Series FR0078 | 9'000'000'000 | IDR | 107.22809 % | 548'149.99 | 0.10 |
| IDG000018300 | 6.875 % Indonesia 21-51 Series FR0089 | 12'000'000'000 | IDR | 99.1395 % | 675'734.81 | 0.12 |
| IDG000018706 | 6 3/8 % Indonesia 21-32 Series FR0091 | 28'000'000'000 | IDR | 98.81724 % | 1'571'589.45 | 0.28 |
| IDG000018805 | 7 1/8 % Indonesia 21-42 Series FR0092 | 24'000'000'000 | IDR | 101.92267 % | 1'389'409.84 | 0.24 |
| IDG000023607 | 6 5/8 % Indonesia 23-34 Series FR0100 | 20'000'000'000 | IDR | 99.7261 % | 1'132'888.53 | 0.20 |

Indonésie **7'105'288.22 1.25**

| | | | | | | |
|--------------|---|---------------|-----|-------------|--------------|------|
| KR103501GC90 | 3 1/8 % Republique de Coree 22-27 Series 03125-2709 (22-8) | 4'600'000'000 | KRW | 99.25181 % | 3'054'375.11 | 0.54 |
| KR103501GD32 | 3 1/4 % Republique de Coree 23-28 Series 03250-2803 (23-1) | 1'400'000'000 | KRW | 99.54473 % | 932'335.95 | 0.16 |
| KR103502G3C1 | 3 3/4 % Republique de Coree 13-33 Series 03750-3312 (13-8) | 2'500'000'000 | KRW | 102.60509 % | 1'716'070.20 | 0.30 |
| KR103502G495 | 3 % Republique de Coree 14-24 Series 03000-2409 (14-5) | 5'600'000'000 | KRW | 99.79031 % | 3'738'544.22 | 0.65 |
| KR103502G4C9 | 2 3/4 % Republique de Coree 14-44 Series 02750-4412 (14-7) | 1'300'000'000 | KRW | 90.64098 % | 788'304.61 | 0.14 |
| KR103502G636 | 2 % Republique de Coree 16-46 Series 02000-4603 (16-1) | 600'000'000 | KRW | 78.85525 % | 316'524.95 | 0.06 |
| KR103502G693 | 1 1/2 % Republique de Coree 16-36 Series 01500-3609 (16-6) | 582'380'000 | KRW | 80.78733 % | 314'757.33 | 0.06 |
| KR103502G735 | 2 1/8 % Republique de Coree 17-47 Series 02125-4703 (17-1) | 1'400'000'000 | KRW | 80.4462 % | 753'459.13 | 0.13 |
| KR103502G792 | 2 1/4 % Republique de Coree 17-37 Series 02250-3709 (17-5) | 2'900'000'000 | KRW | 87.4281 % | 1'696'192.58 | 0.30 |
| KR103502G7C2 | 2 3/8 % Republique de Coree 17-27 Series 02375-2712 (17-7) | 4'800'000'000 | KRW | 96.52963 % | 3'099'759.61 | 0.55 |
| KR103502GA34 | 1 1/2 % Republique de Coree 20-50 Series 01500-5003 (20-2) | 4'550'000'000 | KRW | 71.22072 % | 2'167'923.10 | 0.38 |
| KR103502GB33 | 1 7/8 % Republique de Coree 21-51 Series 01875-5103 (21-2) | 3'000'000'000 | KRW | 75.18009 % | 1'508'864.30 | 0.27 |
| KR103502GB66 | 2 % Republique de Coree 21-31 Series 02000-3106 (21-5) | 500'000'000 | KRW | 90.91801 % | 304'120.76 | 0.05 |
| KR103502GBC0 | 2 3/8 % Republique de Coree 21-31 Series 02375-3112 (21-11) | 400'000'000 | KRW | 92.81815 % | 248'381.37 | 0.04 |
| KR103502GD31 | 3 1/4 % Republique de Coree 23-53 Series 03250-5303 (23-2) | 3'050'000'000 | KRW | 98.70991 % | 2'014'126.28 | 0.35 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|---------------------------------------|---|----------------|---------|-------------|----------------------|--------------|
| KR103503GC98 | 3 1/8 % Republique de Coree 22-24 Series 03125-2409 (22-10) | 1'600'000'000 | KRW | 99.8456 % | 1'068'747.33 | 0.19 |
| Corée du Sud | | | | | 23'722'486.83 | 4.17 |
| MX0MGO0001D6 | 7 1/2 % Mexico 22-33 BS | 1'145'000 | MXN | 89.30 % | 5'540'641.66 | 0.97 |
| Mexique | | | | | 5'540'641.66 | 0.97 |
| MYBGT1900062 | 4.119 % Malaysia 19-34 Series 19/0006 NT | 450'000 | MYR | 102.13569 % | 87'464.87 | 0.02 |
| MYBGX1500062 | 4.786 % Malaysia 15-35 Series 15/0006 NT | 1'000'000 | MYR | 108.18173 % | 205'872.10 | 0.04 |
| MYBMO2000028 | 2.632 % Malaysia 20-31 Series 20/0002 NT | 3'000'000 | MYR | 93.00507 % | 530'971.77 | 0.09 |
| MYBMO2200016 | 3.582 % Malaysia 22-32 Series 22/0001 NT | 5'000'000 | MYR | 98.06043 % | 933'055.24 | 0.16 |
| MYBMS1900047 | 3.828 % Malaysia 19-34 Series 19/0004 NT | 3'000'000 | MYR | 99.70158 % | 569'202.60 | 0.10 |
| MYBMT1800039 | 4.642 % Malaysia 18-33 Series 18/0003 NT | 7'000'000 | MYR | 106.22273 % | 1'415'008.64 | 0.24 |
| MYBMX1000038 | 4.498 % Malaysia 10-30 Series 10/0003 NT | 2'500'000 | MYR | 104.09946 % | 495'258.63 | 0.09 |
| MYBMY1900052 | 3.757 % Malaysia 19-40 Series 19/0005 NT | 1'700'000 | MYR | 96.97583 % | 313'729.95 | 0.06 |
| MYBMZ1800051 | 4.921 % Malaysia 18-48 Series 18/0005 NT | 710'000 | MYR | 111.33045 % | 150'423.56 | 0.03 |
| Malaisie | | | | | 4'700'987.36 | 0.83 |
| TH0623035605 | 0.95 % Thailand 20-25 NT | 10'000'000 | THB | 98.57186 % | 243'326.62 | 0.04 |
| TH0623035C07 | 3.85 % Thailand 10-25 NT | 19'700'000 | THB | 102.82987 % | 500'060.06 | 0.09 |
| TH0623039C03 | 1.60 % Thailand 19-29 NT | 5'000'000 | THB | 96.44814 % | 119'042.09 | 0.02 |
| TH062303D603 | 3.35 % Thailand 22-33 NT | 50'000'000 | THB | 106.90255 % | 1'319'455.44 | 0.23 |
| TH062303M604 | 2 % Thailand 20-42 NT | 13'000'000 | THB | 87.59659 % | 281'104.12 | 0.05 |
| Thaïlande | | | | | 2'462'988.33 | 0.43 |
| Instruments financiers dérivés | | | | | -419'989.68 | -0.07 |
| DAT030226 | 04.04.24 | 432'056'520 | JPY | 1.00 | 2'571'297.97 | 0.45 |
| DAT030226 | 04.04.24 | -3'000'000 | USD | 151.32218 | -2'701'691.09 | -0.48 |
| DAT030228 | 04.04.24 | 549'453'870 | JPY | 1.00 | 3'269'964.82 | 0.57 |
| DAT030228 | 04.04.24 | -3'000'000 | GBP | 191.14857 | -3'412'747.54 | -0.60 |
| DAT030317 | 04.04.24 | 556'118'850 | JPY | 1.00 | 3'309'630.11 | 0.58 |
| DAT030317 | 04.04.24 | -3'000'000 | GBP | 191.14857 | -3'412'747.54 | -0.60 |
| DAT030327 | 04.04.24 | 2'000'000 | USD | 1.00 | 1'801'400.00 | 0.32 |
| DAT030327 | 04.04.24 | -34'731'988 | MXN | 0.06015 | -1'881'744.13 | -0.33 |
| DAT030328 | 04.04.24 | 1'200'000 | EUR | 1.00 | 1'167'300.00 | 0.21 |
| DAT030328 | 04.04.24 | -1'025'826 | GBP | 1.16964 | -1'167'150.69 | -0.21 |
| DAT030329 | 04.04.24 | 800'000 | EUR | 1.00 | 778'200.00 | 0.14 |
| DAT030329 | 04.04.24 | -747'610.4 | CHF | 1.02809 | -747'668.04 | -0.13 |
| DAT030330 | 04.04.24 | 1'200'000 | EUR | 1.00 | 1'167'300.00 | 0.21 |
| DAT030330 | 04.04.24 | -191'120'868 | JPY | 0.00612 | -1'137'544.59 | -0.20 |
| DAT030392 | 16.04.24 | 5'000'000 | USD | 1.00 | 4'503'500.00 | 0.79 |
| DAT030392 | 16.04.24 | -4'388'930 | CHF | 1.11185 | -4'395'281.79 | -0.77 |
| DAT030393 | 16.04.24 | 4'403'890 | CHF | 1.00 | 4'403'890.00 | 0.77 |
| DAT030393 | 16.04.24 | -5'000'000 | USD | 0.8994 | -4'496'992.14 | -0.79 |
| DAT030398 | 16.04.24 | 8'000'000 | CAD | 1.00 | 5'324'663.20 | 0.94 |
| DAT030398 | 16.04.24 | -5'218'168 | CHF | 1.50434 | -5'224'761.08 | -0.92 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|-----------|-------------|----------------|---------|-------------|----------------|-------|
| DAT030410 | 04.04.24 | 371'888'625 | JPY | 1.00 | 2'213'220.77 | 0.39 |
| DAT030410 | 04.04.24 | -2'500'000 | USD | 151.32218 | -2'251'409.24 | -0.40 |
| DAT030412 | 16.04.24 | 223'906'800 | JPY | 1.00 | 1'332'536.54 | 0.23 |
| DAT030412 | 16.04.24 | -1'500'000 | USD | 151.04792 | -1'348'397.22 | -0.24 |
| DAT030432 | 16.04.24 | 6'000'000 | USD | 1.00 | 5'404'200.00 | 0.95 |
| DAT030432 | 16.04.24 | -103'133'742 | MXN | 0.06004 | -5'576'917.36 | -0.98 |
| DAT030433 | 16.04.24 | 2'700'000 | JPY | 1.00 | 16'068.51 | 0.00 |
| DAT030433 | 16.04.24 | -15'931.84 | CHF | 167.9411 | -15'923.36 | 0.00 |
| DAT030434 | 16.04.24 | 2'700'000'000 | JPY | 1.00 | 16'068'510.00 | 2.86 |
| DAT030434 | 16.04.24 | -15'922'656 | CHF | 167.9411 | -15'914'183.19 | -2.80 |
| DAT030435 | 16.04.24 | 3'200'000 | GBP | 1.00 | 3'640'960.00 | 0.64 |
| DAT030435 | 16.04.24 | -3'549'216.64 | CHF | 0.88011 | -3'554'129.09 | -0.62 |
| DAT030436 | 16.04.24 | 133'371'540 | JPY | 1.00 | 793'734.05 | 0.14 |
| DAT030436 | 16.04.24 | -900'000 | USD | 151.04792 | -809'038.33 | -0.14 |
| DAT030437 | 16.04.24 | 1'139'940 | CHF | 1.00 | 1'139'940.00 | 0.20 |
| DAT030437 | 16.04.24 | -1'200'000 | EUR | 0.97183 | -1'166'200.80 | -0.21 |
| DAT030438 | 16.04.24 | 534'301.95 | CHF | 1.00 | 534'301.95 | 0.09 |
| DAT030438 | 16.04.24 | -10'500'000 | MXN | 0.054 | -567'037.08 | -0.10 |
| DAT030439 | 16.04.24 | 150'000'000 | JPY | 1.00 | 892'695.00 | 0.16 |
| DAT030439 | 16.04.24 | -7'275'900 | CNY | 20.80791 | -901'004.48 | -0.16 |
| DAT030440 | 16.04.24 | 2'668'325'150 | JPY | 1.00 | 15'880'003.47 | 2.79 |
| DAT030440 | 16.04.24 | -29'500'000 | NZD | 90.35005 | -15'862'158.07 | -2.79 |
| DAT030441 | 16.04.24 | 3'952'924'000 | COP | 1.00 | 921'031.29 | 0.16 |
| DAT030441 | 16.04.24 | -1'000'000 | USD | 3'874.08524 | -902'661.86 | -0.16 |
| DAT030442 | 16.04.24 | 3'000'000 | USD | 1.00 | 2'702'100.00 | 0.48 |
| DAT030442 | 16.04.24 | -3'996'184'500 | KRW | 0.00074 | -2'675'730.03 | -0.47 |
| DAT030443 | 16.04.24 | 1'500'000 | USD | 1.00 | 1'351'050.00 | 0.24 |
| DAT030443 | 16.04.24 | -10'790'428.5 | CNY | 0.13776 | -1'338'853.27 | -0.24 |
| DAT030444 | 16.04.24 | 146'221'650 | JPY | 1.00 | 870'208.91 | 0.15 |
| DAT030444 | 16.04.24 | -1'500'000 | AUD | 98.57791 | -880'000.05 | -0.15 |
| DAT030445 | 16.04.24 | 5'000'000 | USD | 1.00 | 4'503'500.00 | 0.79 |
| DAT030445 | 16.04.24 | -51'488'550 | SEK | 0.09357 | -4'339'486.21 | -0.76 |
| DAT030446 | 16.04.24 | 1'886'667'000 | JPY | 1.00 | 11'228'121.32 | 1.97 |
| DAT030446 | 16.04.24 | -10'000'000 | GBP | 190.81513 | -11'355'980.74 | -2.00 |
| DAT030447 | 16.04.24 | 1'256'989'500 | CLP | 1.00 | 1'154'293.46 | 0.20 |
| DAT030447 | 16.04.24 | -1'300'000 | USD | 981.18844 | -1'171'332.94 | -0.21 |
| DAT030461 | 15.05.24 | 2'723'325.2 | CHF | 1.00 | 2'723'325.20 | 0.48 |
| DAT030461 | 15.05.24 | -3'100'000 | USD | 0.8965 | -2'779'139.20 | -0.49 |
| DAT030462 | 15.05.24 | 250'000 | USD | 1.00 | 225'175.00 | 0.04 |
| DAT030462 | 15.05.24 | -4'304'335.75 | MXN | 0.05976 | -231'690.29 | -0.04 |
| DAT030468 | 15.05.24 | 4'902'937 | PEN | 1.00 | 1'186'957.41 | 0.21 |
| DAT030468 | 15.05.24 | -1'300'000 | USD | 3.72346 | -1'171'840.96 | -0.21 |
| DAT030473 | 15.05.24 | 2'398'120 | CHF | 1.00 | 2'398'120.00 | 0.42 |
| DAT030473 | 15.05.24 | -400'000'000 | JPY | 0.00596 | -2'384'852.76 | -0.42 |
| DAT030519 | 15.05.24 | 1'792'569 | CHF | 1.00 | 1'792'569.00 | 0.32 |
| DAT030519 | 15.05.24 | -300'000'000 | JPY | 0.00596 | -1'788'639.57 | -0.31 |
| DAT030520 | 16.04.24 | 5'208'056 | CHF | 1.00 | 5'208'056.00 | 0.92 |
| DAT030520 | 16.04.24 | -8'000'000 | CAD | 0.66474 | -5'317'944.34 | -0.94 |

| ISIN | Désignation | Nombre/Nominal | Monnaie | Cours | Valeur vénale | en % |
|---------------------------------------|-------------|----------------|---------|-------------|--------------------|--------------|
| DAT030524 | 15.05.24 | 324'984'600 | JPY | 1.00 | 1'934'080.85 | 0.34 |
| DAT030524 | 15.05.24 | -2'000'000 | EUR | 162.64126 | -1'935'853.84 | -0.34 |
| DAT030525 | 15.05.24 | 5'115'191'900 | COP | 1.00 | 1'191'839.71 | 0.21 |
| DAT030525 | 15.05.24 | -1'300'000 | USD | 3'891.86911 | -1'178'847.15 | -0.21 |
| DAT030526 | 15.05.24 | 162'782'800 | JPY | 1.00 | 968'769.28 | 0.17 |
| DAT030526 | 15.05.24 | -1'000'000 | EUR | 162.64126 | -967'926.92 | -0.17 |
| DAT030530 | 15.05.24 | 20'455'890'000 | IDR | 1.00 | 1'161'894.55 | 0.20 |
| DAT030530 | 15.05.24 | -1'300'000 | USD | 15'877.2659 | -1'172'377.32 | -0.21 |
| DAT030532 | 15.05.24 | 300'000'000 | JPY | 1.00 | 1'785'390.00 | 0.31 |
| DAT030532 | 15.05.24 | -1'783'272 | CHF | 167.72529 | -1'780'032.70 | -0.31 |
| DAT030533 | 15.05.24 | 150'347'400 | JPY | 1.00 | 894'762.48 | 0.16 |
| DAT030533 | 15.05.24 | -1'000'000 | USD | 150.3645 | -894'864.27 | -0.16 |
| DAT030540 | 15.05.24 | 27'001'902 | NOK | 1.00 | 2'241'819.41 | 0.39 |
| DAT030540 | 15.05.24 | -2'000'000 | GBP | 13.69255 | -2'273'633.54 | -0.40 |
| DAT030544 | 15.05.24 | 3'256'568.4 | USD | 1.00 | 2'933'191.16 | 0.52 |
| DAT030544 | 15.05.24 | -3'000'000 | EUR | 1.08181 | -2'923'146.29 | -0.51 |
| Opérations à terme sur devises | | | | | -419'989.68 | -0.07 |

Valeurs mobilières évaluées selon un modèle

| Obligations | | | | | 0.03 | 0.00 |
|--------------------|---|-------------|-----|--------|-------------|-------------|
| RU000A0JU4L3 | 7 % Russia 13-23 Series 26215 | 120'000'000 | RUB | 0.00 % | 0.01 | 0.00 |
| RU000A0JWM07 | 7 3/4 % Russia 16-26 | 27'000'000 | RUB | 0.00 % | 0.00 | 0.00 |
| RU000A0ZYUA9 | 6.90 % Russia 18-29 Series 26224 | 60'000'000 | RUB | 0.00 % | 0.01 | 0.00 |
| RU000A100A82 | 7.65 % Russia 19-30 Series 26228 | 64'000'000 | RUB | 0.00 % | 0.01 | 0.00 |
| RU000A100EF5 | 7.70 % Russia 19-39 Series OFZ-26230-PD | 15'000'000 | RUB | 0.00 % | 0.00 | 0.00 |
| RU000A100EG3 | 7.15 % Russia 19-25 Series OFZ-26229-PD | 19'000'000 | RUB | 0.00 % | 0.00 | 0.00 |
| Russie | | | | | 0.03 | 0.00 |

*Les contrats sur futures ouverts sont sans valeur vénale car le gain ou la perte est comptabilisée directement sur les avoirs en banque à vue.

| Inventaire résumé | Valeur vénale | en % |
|--|-----------------------|---------------|
| Avoirs en banque à vue | 33'351'737.13 | 5.86 |
| Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs | 529'024'805.93 | 93.01 |
| Instruments financiers dérivés | -419'989.68 | -0.07 |
| Autres actifs | 6'807'111.84 | 1.20 |
| Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable | 568'763'665.22 | 100.00 |
| Engagements envers les banques à court terme | -420'739.97 | |
| Autres engagements | -2'316'143.70 | |
| Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable | 566'026'781.55 | |

| | | |
|-----------------|-----|--------------------|
| Cours de change | AUD | 1 = CHF 0.587617 |
| | CAD | 1 = CHF 0.665583 |
| | CLP | 1 = CHF 0.000918 |
| | CNY | 1 = CHF 0.124057 |
| | COP | 1 = CHF 0.000233 |
| | CZK | 1 = CHF 0.03847 |
| | DKK | 100 = CHF 13.04134 |
| | EUR | 1 = CHF 0.97275 |
| | GBP | 1 = CHF 1.1378 |
| | HKD | 100 = CHF 11.50841 |
| | HUF | 100 = CHF 0.24687 |
| | IDR | 100 = CHF 0.00568 |
| | ILS | 1 = CHF 0.245844 |
| | JPY | 100 = CHF 0.59513 |
| | KRW | 100 = CHF 0.0669 |
| | MXN | 100 = CHF 5.4188 |
| | MYR | 100 = CHF 19.03021 |
| | NOK | 100 = CHF 8.30245 |
| | NZD | 1 = CHF 0.538754 |
| | PEN | 1 = CHF 0.242091 |
| | PLN | 100 = CHF 22.58667 |
| | RON | 1 = CHF 0.195721 |
| | RUB | 1 = CHF 0.009729 |
| | SEK | 100 = CHF 8.42358 |
| | SGD | 100 = CHF 66.73829 |
| | THB | 100 = CHF 2.46852 |
| | USD | 1 = CHF 0.9007 |

Risques sur instruments financiers dérivés selon l'approche Commitment II

| Engagement du fonds | % de la fortune nette | Montant |
|--|------------------------------|----------------|
| Engagement total brut résultant de dérivés | 74% | 419'304'239.72 |
| Engagement total net résultant de dérivés | 45% | 252'062'652.22 |
| Engagement de prêts de valeurs mobilières et d'opérations de pension | 0% | 0.00 |
| Informations supplémentaires et opérations hors-bilan | | |
| Valeurs mobilières prêtées à la date du bilan | | 0.00 |
| Valeurs mobilières mises en pension à la date du bilan | | 0.00 |
| Montant du compte prévu pour être réinvesti | | 0.00 |
| Type et montant des sûretés acceptées | | |
| Aucune sûreté acceptée | | 0.00 |
| Contreparties pour les opérations over-the-counter (OTC) | | |
| - Banque Cantonale Vaudoise | | |

Liste des transactions pendant la période comptable

| ISIN | Désignation | Achats 1) | Ventes 2) |
|--|--|------------|------------|
| Positions ouvertes à la fin de la période comptable | | | |
| Obligations | | | |
| AT0000A0U299 | 3.80 % Oesterreich 12-62 | 0 | 85'000 |
| AT0000A10683 | 2.40 % Oesterreich 13-34 | 500'000 | 0 |
| AT0000A1FAP5 | 1.20 % Oesterreich 15-25 | 0 | 420'000 |
| AT0000A1K9F1 | 1 1/2 % Oesterreich 16-47 | 0 | 320'000 |
| AT0000A1VGK0 | 1/2 % Oesterreich 17-27 | 0 | 210'000 |
| AT0000A2EJ08 | 3/4 % Oesterreich 20-51 | 285'000 | 0 |
| AT0000A2KQ43 | 0 % Oesterreich 20-40 NT | 400'000 | 0 |
| AT0000A2NW83 | 0 % Oesterreich 21-31 | 300'000 | 0 |
| AT0000A2WSC8 | 0.90 % Oesterreich 22-32 | 1'430'000 | 530'000 |
| AT0000A33SK7 | 3.15 % Oesterreich 23-53 | 800'000 | 200'000 |
| AU0000013740 | 2 1/2 % Australia 18-30 NT | 0 | 1'300'000 |
| AU0000097495 | 1 3/4 % Australia 20-51 Series 162 NT | 500'000 | 0 |
| AU000XCLWAG2 | 4 1/2 % Australia 13-33 Series 140 TB | 4'150'000 | 740'000 |
| AU000XCLWAR9 | 2 1/4 % Australia 16-28 NT | 5'060'000 | 1'300'000 |
| AU3TB0000168 | 3 1/4 % Australia 13-25 NT Series 139 TB | 0 | 1'300'000 |
| BE0000320292 | 4 1/4 % Belgique 10-41 Unitary 60 OLO | 117'000 | 0 |
| BE0000326356 | 4 % Belgique 12-32 Unitary 66 OLO | 868'000 | 0 |
| BE0000343526 | 2 1/4 % Belgique 17-57 Unitary 83 OLO | 200'000 | 0 |
| BE0000348574 | 1.70 % Belgique 19-50 Unitary 88 OLO | 150'000 | 0 |
| BE0000354630 | 0.35 % Belgique 22-32 Unitary 94 OLO | 1'130'000 | 630'000 |
| CA135087H722 | 2 % Canada 17-51 Series H722 TB | 0 | 320'000 |
| CA135087L930 | 1 % Canada 21-26 TB | 1'500'000 | 0 |
| CA135087M276 | 1 1/2 % Canada 21-31 TB | 1'400'000 | 1'000'000 |
| CA135087M680 | 1 3/4 % Canada 21-53 TB | 800'000 | 0 |
| CA135087Q236 | 2 3/4 % Canada 23-33 TB | 3'300'000 | 1'240'000 |
| CA135087Q491 | 3 1/4 % Canada 23-28 TB | 1'300'000 | 0 |
| CA135087XG49 | 5 3/4 % Canada 01-33 Series XG49 TB | 400'000 | 0 |
| CND10002D1Y9 | 3.86 % République Populaire de Chine 19-49 NT | 0 | 12'000'000 |
| CND10002M200 | 3.39 % République Populaire de Chine 20-50 NT | 0 | 8'000'000 |
| CND10003R702 | 3.02 % République Populaire de Chine 20-25 NT | 40'000'000 | 19'000'000 |
| CND10004LLJ6 | 2.47 % République Populaire de Chine 21-24 NT | 0 | 10'000'000 |
| CND10004TCP5 | 3.32 % République Populaire de Chine 22-52 NT | 21'000'000 | 7'900'000 |
| CND10005F4L5 | 2 1/2 % République Populaire de Chine 22-27 NT | 20'000'000 | 0 |
| CND10005L4G7 | 2.60 % République Populaire de Chine 22-32 NT | 39'000'000 | 16'000'000 |
| CND100069PK9 | 3.19 % République Populaire de Chine 23-53 NT | 15'000'000 | 0 |
| CND10006GPT1 | 2.67 % République Populaire de Chine 23-33 NT | 28'000'000 | 0 |
| CND10006PJH0 | 2.40 % République Populaire de Chine 23-28 NT | 7'000'000 | 0 |
| CND10007C5P4 | 2.37 % République Populaire de Chine 24-29 NT | 26'000'000 | 0 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| ISIN | Désignation | Achats 1) | Ventes 2) |
|--------------|--|------------|------------|
| CZ0001002547 | 5.70 % Czech Republic 09-24 Series 58 | 0 | 12'300'000 |
| CZ0001003859 | 2 1/2 % Czech Republic 13-28 Series 78 | 22'000'000 | 0 |
| CZ0001004477 | 0.95 % Czech Republic 15-30 Series 94 | 12'500'000 | 0 |
| CZ0001005243 | 2 % Czech Republic 17-33 Series 103 | 17'700'000 | 0 |
| DE0001102374 | 1/2 % Deutschland 15-25 | 0 | 320'000 |
| DE0001102390 | 1/2 % Deutschland 16-26 | 0 | 2'200'000 |
| DE0001102432 | 1 1/4 % Deutschland 17-48 | 0 | 420'000 |
| DE0001102440 | 1/2 % Deutschland 18-28 | 10'000'000 | 3'700'000 |
| DE0001102614 | 1.80 % Deutschland 22-53 | 16'330'000 | 12'430'000 |
| DE0001135432 | 3 1/4 % Deutschland 10-42 | 1'550'000 | 850'000 |
| DE0001135481 | 2 1/2 % Deutschland 12-44 | 500'000 | 0 |
| DE000BU27006 | 2.40 % Deutschland 23-30 | 1'000'000 | 0 |
| DE000BU2D004 | 2 1/2 % Deutschland 24-54 | 3'000'000 | 0 |
| DE000BU2Z007 | 2.30 % Deutschland 23-33 | 30'500'000 | 23'000'000 |
| DE000BU2Z015 | 2.60 % Deutschland 23-33 | 1'000'000 | 0 |
| DK0009923807 | 1/2 % Denmark 19-29 TB | 2'800'000 | 2'100'000 |
| DK0009924532 | 2 1/4 % Denmark 23-33 TB | 3'300'000 | 2'100'000 |
| ES00000121S7 | 4.70 % Espana 09-41 BS | 1'000'000 | 0 |
| ES00000126Z1 | 1.60 % Espana 15-25 BS | 0 | 1'158'000 |
| ES00000127A2 | 1.95 % Espana 15-30 BS | 1'500'000 | 0 |
| ES0000012932 | 4.20 % Espana 05-37 BS | 1'350'000 | 0 |
| ES0000012E51 | 1.45 % Espana 19-29 BS | 1'840'000 | 740'000 |
| ES0000012G00 | 1 % Espana 20-50 BS | 0 | 420'000 |
| ES0000012I32 | 1/2 % Espana 21-31 BS | 1'400'000 | 0 |
| ES0000012K46 | 1.90 % Espana 22-52 BS | 870'000 | 270'000 |
| ES0000012K61 | 2.55 % Espana 22-32 BS | 2'400'000 | 1'200'000 |
| FI4000148630 | 3/4 % Finland 15-31 TB | 1'450'000 | 950'000 |
| FI4000480488 | 1/8 % Finland 21-52 TB | 300'000 | 0 |
| FR0000187635 | 5 3/4 % France 01-32 OAT | 5'000'000 | 1'433'000 |
| FR0010773192 | 4 1/2 % France 09-41 OAT | 200'000 | 0 |
| FR0011461037 | 3 1/4 % France 13-45 OAT | 0 | 880'000 |
| FR0012938116 | 1 % France 15-25 OAT | 2'400'000 | 1'700'000 |
| FR0012993103 | 1 1/2 % France 15-31 OAT | 1'100'000 | 0 |
| FR0013286192 | 3/4 % France 17-28 OAT | 200'000 | 1'300'000 |
| FR0013480613 | 3/4 % France 19-52 OAT | 1'900'000 | 460'000 |
| FR001400CMX2 | 2 1/2 % France 22-43 OAT | 1'400'000 | 0 |
| GB00B1VWPJ53 | 4 1/2 % United Kingdom 07-42 TB | 1'600'000 | 2'500'000 |
| GB00B6RNH572 | 3 3/4 % United Kingdom 11-52 TB | 14'300'000 | 16'500'000 |
| GB00BDRHNP05 | 1 1/4 % United Kingdom 17-27 TB | 0 | 3'500'000 |
| GB00BFX0ZL78 | 1 5/8 % United Kingdom 18-28 TB | 3'432'000 | 2'325'000 |
| GB00BL68HJ26 | 1/8 % United Kingdom 20-26 TB | 3'300'000 | 0 |
| GB00BPCJD997 | 3 3/4 % United Kingdom 23-53 TB | 45'500'000 | 30'650'000 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| ISIN | Désignation | Achats 1) | Ventes 2) |
|--------------|--|----------------|----------------|
| GB00BPJJKN53 | 4 5/8 % United Kingdom 23-34 TB | 4'500'000 | 600'000 |
| GR0124040743 | 3 3/8 % Grece 24-34 | 1'000'000 | 0 |
| IDG000018300 | 6.875 % Indonesia 21-51 Series FR0089 | 12'000'000'000 | 0 |
| IDG000018706 | 6 3/8 % Indonesia 21-32 Series FR0091 | 0 | 15'000'000'000 |
| IDG000018805 | 7 1/8 % Indonesia 21-42 Series FR0092 | 12'000'000'000 | 0 |
| IDG000023607 | 6 5/8 % Indonesia 23-34 Series FR0100 | 20'000'000'000 | 0 |
| IE00BH3SQ895 | 1.10 % Ireland 19-29 TB | 750'000 | 0 |
| IE00BMQ5JM72 | 0.55 % Ireland 21-41 TB | 400'000 | 0 |
| IL0011508798 | 2 1/4 % Israel 18-28 Classe SHA | 2'400'000 | 2'100'000 |
| IL0011806606 | 1.30 % Israel 21-32 | 1'700'000 | 1'600'000 |
| IT0005162828 | 2.70 % Italia 16-47 BT | 0 | 900'000 |
| IT0005421703 | 1.80 % Italia 20-41 BT | 900'000 | 0 |
| IT0005425233 | 1.70 % Italia 20-51 BT | 1'200'000 | 0 |
| IT0005433690 | 1/4 % Italia 21-28 BT | 4'400'000 | 1'400'000 |
| IT0005466013 | 0.95 % Italia 21-32 BT | 7'300'000 | 2'300'000 |
| JP1103361EC6 | 1/2 % Japan 14-24 No 336 | 0 | 110'000'000 |
| JP1103701P43 | 1/2 % Japan 23-33 Series 370 TB | 2'020'000'000 | 370'000'000 |
| JP1201231AC0 | 2.10 % Japan 10-30 No 123 | 80'000'000 | 250'000'000 |
| JP1201411CC4 | 1.70 % Japan 12-32 No 141 | 0 | 250'000'000 |
| JP1201851P76 | 1.10 % Japan 23-43 Series 185 TB | 220'000'000 | 0 |
| JP1300371C98 | 1.90 % Japan 12-42 No 37 | 625'000'000 | 325'000'000 |
| JP1300801PA2 | 1.80 % Japan 23-53 Series 80 TB | 280'000'000 | 0 |
| JP1400051C51 | 2 % Japan 12-52 Series 5 TB | 440'000'000 | 290'000'000 |
| JP1400161P53 | 1.3 % Japan 23-63 Series 16 TB | 200'000'000 | 0 |
| KR103501GD32 | 3 1/4 % Republique de Coree 23-28 Series 03250-2803 (23-1) | 1'400'000'000 | 0 |
| KR103502G4C9 | 2 3/4 % Republique de Coree 14-44 Series 02750-4412 (14-7) | 1'300'000'000 | 0 |
| KR103502GB66 | 2 % Republique de Coree 21-31 Series 02000-3106 (21-5) | 500'000'000 | 0 |
| KR103502GD31 | 3 1/4 % Republique de Coree 23-53 Series 03250-5303 (23-2) | 3'050'000'000 | 0 |
| MX0MGO000078 | 10 % Mexico 05-24 Series M BS | 0 | 180'000 |
| MX0MGO0001D6 | 7 1/2 % Mexico 22-33 BS | 1'145'000 | 0 |
| MYBMO2200016 | 3.582 % Malaysia 22-32 Series 22/0001 NT | 0 | 8'000'000 |
| MYBMT1800039 | 4.642 % Malaysia 18-33 Series 18/0003 NT | 7'000'000 | 0 |
| NL0009446418 | 3 3/4 % Niederlande 10-42 | 800'000 | 490'000 |
| NL0010071189 | 2 1/2 % Niederlande 12-33 | 800'000 | 0 |
| NL0015000RP1 | 1/2 % Niederlande 20-32 | 600'000 | 850'000 |
| NL0015614579 | 0 % Niederlande 20-52 | 1'000'000 | 1'100'000 |
| NZGOVDT433C9 | 3 1/2 % New Zealand 15-33 NT | 10'000'000 | 10'420'000 |
| NZGOVDT541C9 | 1 3/4 % New Zealand 20-41 NT | 0 | 210'000 |
| PL0000109427 | 2 1/2 % Poland 16-27 Series DS0727 | 1'200'000 | 0 |
| PL0000112736 | 1 1/4 % Poland 20-30 Series DS1030 | 3'200'000 | 0 |
| PL0000115291 | 6 % Poland 22-33 Series DS1033 | 4'800'000 | 0 |
| PTOTENOE0034 | 0.90 % Republique Portugaise 20-35 BT | 400'000 | 530'000 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| ISIN | Désignation | Achats 1) | Ventes 2) |
|--------------|--|------------|------------|
| PTOTEOOE0033 | 0.30 % Republique Portugaise 21-31 BT | 1'200'000 | 0 |
| PTOTEPOE0032 | 1.15 % Republique Portugaise 22-42 BT | 300'000 | 0 |
| PTOTEVOE0018 | 2 1/8 % Republique Portugaise 18-28 BT | 1'753'000 | 750'000 |
| SE0004517290 | 2 1/4 % Sverige 12-32 Series 1056 TB | 57'000'000 | 46'500'000 |
| SE0009496367 | 3/4 % Sverige 28 17-28 Series 1060 TB | 40'000'000 | 0 |
| SG3261987691 | 3 3/8 % Singapore 13-33 TB | 1'000'000 | 0 |
| SG7J60932174 | 3 1/2 % Singapore 07-27 | 500'000 | 0 |
| SG7U32949426 | 2 7/8 % Singapore 10-30 NT TB | 0 | 1'200'000 |
| SGXF27246101 | 1 7/8 % Singapore 20-50 TB | 300'000 | 0 |
| SGXF46767848 | 2 5/8 % Singapore 22-32 TB | 250'000 | 0 |
| TH0623035C07 | 3.85 % Thailand 10-25 NT | 0 | 5'300'000 |
| US912810PW27 | 4 3/8 % USA 08-38 TB | 0 | 350'000 |
| US912810QS06 | 3 3/4 % USA 11-41 TB | 1'200'000 | 0 |
| US912810QW18 | 3 % USA 12-42 TB | 4'750'000 | 3'350'000 |
| US912810TF57 | 2 3/8 % USA 22-42 TB | 1'700'000 | 1'150'000 |
| US912810TV08 | 4 3/4 % USA 23-53 TB | 9'800'000 | 2'700'000 |
| US912810TX63 | 4 1/4 % USA 24-54 Series 2054 TB | 800'000 | 0 |
| US9128282A70 | 1 1/2 % USA 26 16-26 Series E-2026 TB | 0 | 7'200'000 |
| US91282CAU53 | 1/2 % USA 20-27 Series R-2027 TB | 0 | 200'000 |
| US91282CCE93 | 1 1/4 % USA 21-28 Series L-2028 TB | 26'700'000 | 6'100'000 |
| US91282CDW82 | 1 3/4 % USA 22-29 Series G-2029 TB | 9'000'000 | 0 |
| US91282CFV81 | 4 1/8 % USA 22-32 TB | 2'500'000 | 0 |
| US91282CGM73 | 3 1/2 % USA 23-33 TB | 31'950'000 | 23'950'000 |

Positions fermées en cours de période comptable

Obligations

| | | | |
|--------------|---|------------|------------|
| AT0000A105W3 | 1 3/4 % Oesterreich 13-23 | 0 | 800'000 |
| AT0000A1PE50 | 0 % Oesterreich 16-23 | 0 | 230'000 |
| BE0000332412 | 2.60 % Belgique 14-24 Unitary 72 OLO | 0 | 1'000'000 |
| BE0000339482 | 0.20 % Belgique 16-23 Unitary 79 OLO | 0 | 566'000 |
| BE0000345547 | 0.80 % Belgique 18-28 Unitary 85 OLO | 0 | 300'000 |
| BE0000359688 | 3.45 % Belgique 23-43 Unitary 99 OLO | 400'000 | 400'000 |
| CA135087M920 | 3/4 % Canada 20-24 TB | 0 | 4'350'000 |
| CND100025LF0 | 3.19 % Republique Populaire de Chine 19-24 NT | 0 | 22'500'000 |
| DE0001102572 | 0 % Deutschland 21-52 | 2'500'000 | 5'000'000 |
| ES00000123X3 | 4.40 % Espana 13-23 BS | 0 | 1'250'000 |
| ES0000012K95 | 3.45 % Espana 22-43 BS | 400'000 | 400'000 |
| FR0011619436 | 2 1/4 % France 13-24 OAT | 0 | 3'000'000 |
| GB00BM8Z2S21 | 7/8 % United Kingdom 21-33 TB | 11'500'000 | 12'400'000 |
| GB00BM8Z2T38 | 1 % United Kingdom 21-32 TB | 2'700'000 | 5'400'000 |
| GB00BMV7TC88 | 3 1/4 % United Kingdom 23-33 TB | 5'100'000 | 5'100'000 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| ISIN | Désignation | Achats 1) | Ventes 2) |
|--------------|---|---------------|----------------|
| GB00BTHH2R79 | 2 % United Kingdom 15-25 TB | 10'000'000 | 13'300'000 |
| IDG000012006 | 8 3/8 % Indonesia 13-24 Series FR0070 | 0 | 31'000'000'000 |
| IE00B6X95T99 | 3.40 % Ireland 14-24 TB | 0 | 500'000 |
| IL0011267478 | 4 1/4 % Israel 12-23 | 0 | 1'100'000 |
| IT0005246340 | 1.85 % Italia 17-24 BT | 0 | 1'650'000 |
| IT0005386245 | 0.35 % Italia 19-25 BT | 0 | 2'500'000 |
| JP1103421G35 | 0.10 % Japan 16-26 No 342 | 0 | 600'000'000 |
| JP1103471H66 | 0.10 % Japan 17-27 No 347 | 0 | 1'000'000'000 |
| JP12009917C3 | 2.10 % Japan 07-27 No 99 | 0 | 300'000'000 |
| JP1201081914 | 1.90 % Japan 09-28 No 108 | 100'000'000 | 334'450'000 |
| KR103502GCC8 | 4 1/4 % Republique de Coree 22-32 Series 04250-3212 (22-14) | 4'000'000'000 | 4'000'000'000 |
| NO0010705536 | 3 % Norway 14-24 TB | 0 | 1'316'000 |
| NO0012837642 | 3 % Norway 23-33 TB | 7'000'000 | 7'000'000 |
| PL0000107264 | 4 % Poland 12-23 Series DS1023 | 0 | 4'600'000 |
| US912810TD00 | 2 1/4 % USA 22-52 Series 2052 TB | 200'000 | 4'000'000 |
| US912810TJ79 | 3 % USA 22-52 TB | 4'450'000 | 7'650'000 |
| US912828M565 | 2 1/4 % USA 15-25 Series F-2025 TB | 0 | 6'500'000 |
| US912828XT22 | 2 % USA 17-24 Series L-2024 TB | 4'000'000 | 13'000'000 |
| US91282CAJ09 | 1/4 % USA 20-25 Series AC-2025 TB | 2'800'000 | 3'400'000 |
| US91282CBW01 | 3/4 % USA 21-26 Series Y-2026 TB | 0 | 4'200'000 |
| US91282CCS89 | 1 1/4 % USA 21-31 Series E-2031 TB | 0 | 6'500'000 |
| US91282CFF32 | 2 3/4 USA 22-32 Series E-2032 TB | 0 | 3'200'000 |

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|--------|---------|--------|---------|--------|
|-----------------|-------------|----------|--------|---------|--------|---------|--------|

Positions ouvertes à la fin de la période comptable

Opérations à terme sur devises

| | | | | | | |
|-----------|----------|-----------|-----|----------------|-----|----------------|
| DAT030226 | 04.04.24 | 144.01884 | JPY | 432'056'520.00 | USD | 3'000'000.00 |
| DAT030228 | 04.04.24 | 183.15129 | JPY | 549'453'870.00 | GBP | 3'000'000.00 |
| DAT030317 | 04.04.24 | 185.37295 | JPY | 556'118'850.00 | GBP | 3'000'000.00 |
| DAT030327 | 04.04.24 | 0.05758 | USD | 2'000'000.00 | MXN | 34'731'988.00 |
| DAT030328 | 04.04.24 | 1.16979 | EUR | 1'200'000.00 | GBP | 1'025'826.00 |
| DAT030329 | 04.04.24 | 1.07008 | EUR | 800'000.00 | CHF | 747'610.40 |
| DAT030330 | 04.04.24 | 0.00628 | EUR | 1'200'000.00 | JPY | 191'120'868.00 |
| DAT030392 | 16.04.24 | 1.13923 | USD | 5'000'000.00 | CHF | 4'388'930.00 |
| DAT030393 | 16.04.24 | 0.88078 | CHF | 4'403'890.00 | USD | 5'000'000.00 |
| DAT030398 | 16.04.24 | 1.53311 | CAD | 8'000'000.00 | CHF | 5'218'168.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|--------------|---------|-------------------|---------|------------------|
| DAT030410 | | 04.04.24 | 148.75545 | JPY | 371'888'625.00 | USD | 2'500'000.00 |
| DAT030412 | | 16.04.24 | 149.27120 | JPY | 223'906'800.00 | USD | 1'500'000.00 |
| DAT030432 | | 16.04.24 | 0.05818 | USD | 6'000'000.00 | MXN | 103'133'742.00 |
| DAT030433 | | 16.04.24 | 169.47195 | JPY | 2'700'000.00 | CHF | 15'931.84 |
| DAT030434 | | 16.04.24 | 169.56970 | JPY | 2'700'000'000.00 | CHF | 15'922'656.00 |
| DAT030435 | | 16.04.24 | 0.90161 | GBP | 3'200'000.00 | CHF | 3'549'216.64 |
| DAT030436 | | 16.04.24 | 148.19060 | JPY | 133'371'540.00 | USD | 900'000.00 |
| DAT030437 | | 16.04.24 | 0.94995 | CHF | 1'139'940.00 | EUR | 1'200'000.00 |
| DAT030438 | | 16.04.24 | 0.05089 | CHF | 534'301.95 | MXN | 10'500'000.00 |
| DAT030439 | | 16.04.24 | 20.61601 | JPY | 150'000'000.00 | CNY | 7'275'900.00 |
| DAT030440 | | 16.04.24 | 90.45170 | JPY | 2'668'325'150.00 | NZD | 29'500'000.00 |
| DAT030441 | | 16.04.24 | 3'952.92400 | COP | 3'952'924'000.00 | USD | 1'000'000.00 |
| DAT030442 | | 16.04.24 | 0.00075 | USD | 3'000'000.00 | KRW | 3'996'184'500.00 |
| DAT030443 | | 16.04.24 | 0.13901 | USD | 1'500'000.00 | CNY | 10'790'428.50 |
| DAT030444 | | 16.04.24 | 97.48110 | JPY | 146'221'650.00 | AUD | 1'500'000.00 |
| DAT030445 | | 16.04.24 | 0.09711 | USD | 5'000'000.00 | SEK | 51'488'550.00 |
| DAT030446 | | 16.04.24 | 188.66670 | JPY | 1'886'667'000.00 | GBP | 10'000'000.00 |
| DAT030447 | | 16.04.24 | 966.91500 | CLP | 1'256'989'500.00 | USD | 1'300'000.00 |
| DAT030461 | | 15.05.24 | 0.87849 | CHF | 2'723'325.20 | USD | 3'100'000.00 |
| DAT030462 | | 15.05.24 | 0.05808 | USD | 250'000.00 | MXN | 4'304'335.75 |
| DAT030468 | | 15.05.24 | 3.77149 | PEN | 4'902'937.00 | USD | 1'300'000.00 |
| DAT030473 | | 15.05.24 | 0.00600 | CHF | 2'398'120.00 | JPY | 400'000'000.00 |
| DAT030519 | | 15.05.24 | 0.00598 | CHF | 1'792'569.00 | JPY | 300'000'000.00 |
| DAT030520 | | 16.04.24 | 0.65101 | CHF | 5'208'056.00 | CAD | 8'000'000.00 |
| DAT030524 | | 15.05.24 | 162.49230 | JPY | 324'984'600.00 | EUR | 2'000'000.00 |
| DAT030525 | | 15.05.24 | 3'934.76300 | COP | 5'115'191'900.00 | USD | 1'300'000.00 |
| DAT030526 | | 15.05.24 | 162.78280 | JPY | 162'782'800.00 | EUR | 1'000'000.00 |
| DAT030530 | | 15.05.24 | 15'735.30000 | IDR | 20'455'890'000.00 | USD | 1'300'000.00 |
| DAT030532 | | 15.05.24 | 168.23008 | JPY | 300'000'000.00 | CHF | 1'783'272.00 |
| DAT030533 | | 15.05.24 | 150.34740 | JPY | 150'347'400.00 | USD | 1'000'000.00 |
| DAT030540 | | 15.05.24 | 13.50095 | NOK | 27'001'902.00 | GBP | 2'000'000.00 |
| DAT030544 | | 15.05.24 | 1.08552 | USD | 3'256'568.40 | EUR | 3'000'000.00 |

Futures

| | | | | | | | |
|--------------|----------------------|----------|--|--|----------|--|--------|
| CBOT.TN50624 | US T-NOTES 5 Y | 30.06.24 | | | 410.00 | | |
| CBOT.UL10624 | US ULTRABOND 10 YEAR | 30.06.24 | | | | | 200.00 |
| CBOT.ULT0624 | US ULTRABOND 30 YEAR | 30.06.24 | | | | | 85.00 |
| EURO.SH0624 | EURO SCHATZ EUREX | 30.06.24 | | | 1'650.00 | | 840.00 |
| EURX.BD30624 | EUREX EURO BUND 30 Y | 30.06.24 | | | 125.00 | | 220.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|--------|---------|--------|---------|--------|
| EURX.BOB0624 | EURO-BOBL | 30.06.24 | | | 430.00 | | 730.00 |
| LIF.LG0624 | LONG GILT | 30.06.24 | | | 350.00 | | 200.00 |

Positions fermées en cours de période comptable

Opérations à terme sur devises

| | | | | | | | |
|-----------|--|----------|-------------|-----|------------------|-----|------------------|
| DAT029000 | | 11.05.23 | 0.09720 | USD | 2'500'000.00 | NOK | 25'719'530.00 |
| DAT029001 | | 14.04.23 | 1.00760 | SEK | 1'309'878.70 | NOK | 1'300'000.00 |
| DAT029006 | | 11.05.23 | 0.09693 | USD | 2'500'000.00 | SEK | 25'792'517.50 |
| DAT029007 | | 11.05.23 | 131.37670 | JPY | 656'883'500.00 | USD | 5'000'000.00 |
| DAT029016 | | 11.05.23 | 0.00691 | CHF | 2'072'801.40 | JPY | 300'000'000.00 |
| DAT029029 | | 11.05.23 | 0.00763 | USD | 5'000'000.00 | JPY | 655'507'500.00 |
| DAT029039 | | 13.06.23 | 1.00687 | NOK | 85'000'000.00 | SEK | 84'419'994.00 |
| DAT029040 | | 15.06.23 | 0.00077 | USD | 2'000'000.00 | KRW | 2'599'620'000.00 |
| DAT029043 | | 14.06.23 | 149.20538 | JPY | 200'000'000.00 | CHF | 1'340'434.20 |
| DAT029045 | | 14.06.23 | 149.78513 | JPY | 600'000'000.00 | CHF | 4'005'738.00 |
| DAT029046 | | 14.06.23 | 149.72660 | JPY | 600'000'000.00 | CHF | 4'007'304.00 |
| DAT029080 | | 11.05.23 | 0.00670 | CHF | 2'010'174.00 | JPY | 300'000'000.00 |
| DAT029083 | | 11.05.23 | 0.00668 | CHF | 668'418.00 | JPY | 100'000'000.00 |
| DAT029086 | | 28.06.23 | 4'620.51000 | COP | 6'468'714'000.00 | USD | 1'400'000.00 |
| DAT029088 | | 11.05.23 | 170.71310 | JPY | 426'782'750.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029089 | | 11.05.23 | 152.82084 | JPY | 150'000'000.00 | CHF | 981'541.50 |
| DAT029091 | | 13.06.23 | 1.04118 | NOK | 30'000'000.00 | SEK | 28'813'500.00 |
| DAT029095 | | 11.05.23 | 83.90710 | JPY | 335'628'400.00 | NZD | 4'000'000.00 |
| DAT029099 | | 11.05.23 | 151.68591 | JPY | 300'000'000.00 | CHF | 1'977'771.00 |
| DAT029100 | | 11.05.23 | 135.83340 | JPY | 339'583'500.00 | USD | 2'500'000.00 |
| DAT029103 | | 13.06.23 | 1.04791 | NOK | 30'000'000.00 | SEK | 28'628'400.00 |
| DAT029104 | | 11.05.23 | 0.00587 | GBP | 2'500'000.00 | JPY | 425'545'000.00 |
| DAT029114 | | 11.05.23 | 0.00656 | CHF | 983'896.50 | JPY | 150'000'000.00 |
| DAT029116 | | 11.05.23 | 0.00737 | USD | 2'500'000.00 | JPY | 339'035'000.00 |
| DAT029117 | | 15.06.23 | 10.66169 | NOK | 26'654'227.50 | USD | 2'500'000.00 |
| DAT029120 | | 13.06.23 | 0.95637 | SEK | 28'690'950.00 | NOK | 30'000'000.00 |
| DAT029121 | | 11.05.23 | 0.00660 | CHF | 1'979'679.00 | JPY | 300'000'000.00 |
| DAT029124 | | 15.06.23 | 0.09410 | USD | 2'500'000.00 | NOK | 26'566'610.00 |
| DAT029131 | | 13.06.23 | 0.96665 | SEK | 19'332'980.00 | NOK | 20'000'000.00 |
| DAT029132 | | 14.06.23 | 147.41573 | JPY | 515'955'055.00 | EUR | 3'500'000.00 |
| DAT029134 | | 14.06.23 | 84.93520 | JPY | 2'038'444'800.00 | NZD | 24'000'000.00 |
| DAT029135 | | 14.06.23 | 169.49771 | JPY | 423'744'275.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029136 | | 14.06.23 | 134.31842 | JPY | 805'910'520.00 | USD | 6'000'000.00 |
| DAT029137 | | 14.06.23 | 0.93484 | AUD | 8'000'000.00 | NZD | 8'557'592.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-----------|---------|------------------|---------|----------------|
| DAT029144 | | 14.06.23 | 0.00680 | EUR | 600'000.00 | JPY | 88'248'540.00 |
| DAT029145 | | 13.06.23 | 0.96933 | SEK | 9'693'330.00 | NOK | 10'000'000.00 |
| DAT029153 | | 14.06.23 | 0.00664 | CHF | 663'854.00 | JPY | 100'000'000.00 |
| DAT029154 | | 14.06.23 | 0.01185 | NZD | 2'000'000.00 | JPY | 168'801'600.00 |
| DAT029155 | | 14.06.23 | 0.00666 | CHF | 666'466.00 | JPY | 100'000'000.00 |
| DAT029156 | | 13.06.23 | 1.03368 | NOK | 16'000'000.00 | SEK | 15'478'752.00 |
| DAT029157 | | 14.06.23 | 1.61009 | NZD | 4'500'000.00 | USD | 2'794'873.50 |
| DAT029158 | | 14.06.23 | 10.64677 | NOK | 59'621'912.00 | USD | 5'600'000.00 |
| DAT029159 | | 14.06.23 | 0.05645 | USD | 5'300'000.00 | MXN | 93'882'461.60 |
| DAT029160 | | 14.06.23 | 0.09389 | USD | 2'800'000.00 | NOK | 29'823'116.40 |
| DAT029161 | | 14.06.23 | 0.62538 | USD | 5'628'375.00 | NZD | 9'000'000.00 |
| DAT029162 | | 14.06.23 | 1.07387 | NZD | 4'295'488.00 | AUD | 4'000'000.00 |
| DAT029163 | | 13.06.23 | 0.97257 | SEK | 15'561'088.00 | NOK | 16'000'000.00 |
| DAT029167 | | 14.06.23 | 151.45985 | JPY | 100'000'000.00 | CHF | 660'241.00 |
| DAT029168 | | 14.06.23 | 84.20660 | JPY | 168'413'200.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029169 | | 14.06.23 | 151.89258 | JPY | 100'000'000.00 | CHF | 658'360.00 |
| DAT029170 | | 14.06.23 | 1.07703 | NZD | 4'308'132.00 | AUD | 4'000'000.00 |
| DAT029175 | | 13.07.23 | 806.38000 | CLP | 1'128'932'000.00 | USD | 1'400'000.00 |
| DAT029176 | | 14.06.23 | 152.62005 | JPY | 200'000'000.00 | CHF | 1'310'443.80 |
| DAT029177 | | 13.06.23 | 1.03327 | NOK | 38'000'000.00 | SEK | 36'776'362.00 |
| DAT029178 | | 14.06.23 | 0.62365 | USD | 1'621'484.80 | NZD | 2'600'000.00 |
| DAT029179 | | 14.06.23 | 85.34420 | JPY | 170'688'400.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029180 | | 14.06.23 | 152.19264 | JPY | 200'000'000.00 | CHF | 1'314'124.00 |
| DAT029181 | | 13.07.23 | 3.70408 | PEN | 4'444'900.80 | USD | 1'200'000.00 |
| DAT029186 | | 13.06.23 | 0.97165 | SEK | 14'574'795.00 | NOK | 15'000'000.00 |
| DAT029190 | | 13.06.23 | 0.96888 | SEK | 14'533'245.00 | NOK | 15'000'000.00 |
| DAT029191 | | 14.06.23 | 0.94339 | AUD | 4'000'000.00 | NZD | 4'240'024.00 |
| DAT029192 | | 14.06.23 | 1.14853 | EUR | 2'200'000.00 | GBP | 1'915'494.24 |
| DAT029207 | | 14.06.23 | 1.07021 | NZD | 4'280'836.00 | AUD | 4'000'000.00 |
| DAT029208 | | 14.06.23 | 0.01179 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 84'784'400.00 |
| DAT029209 | | 14.06.23 | 0.01182 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 84'582'900.00 |
| DAT029212 | | 20.07.23 | 13.55319 | NOK | 33'882'965.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029213 | | 20.07.23 | 6.66945 | NOK | 26'677'796.00 | NZD | 4'000'000.00 |
| DAT029215 | | 14.06.23 | 0.01185 | NZD | 2'000'000.00 | JPY | 168'718'800.00 |
| DAT029220 | | 14.06.23 | 84.56130 | JPY | 169'122'600.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029226 | | 14.06.23 | 0.01185 | NZD | 2'000'000.00 | JPY | 168'729'600.00 |
| DAT029239 | | 20.07.23 | 0.14984 | NZD | 4'000'000.00 | NOK | 26'695'936.00 |
| DAT029240 | | 13.06.23 | 0.97671 | SEK | 10'743'755.00 | NOK | 11'000'000.00 |
| DAT029242 | | 31.07.23 | 0.08969 | USD | 2'700'000.00 | NOK | 30'102'019.20 |
| DAT029243 | | 14.06.23 | 0.01195 | NZD | 1'500'000.00 | JPY | 125'544'450.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-------------|---------|------------------|---------|------------------|
| DAT029245 | | 31.07.23 | 11.21292 | NOK | 30'274'886.70 | USD | 2'700'000.00 |
| DAT029246 | | 31.07.23 | 1'321.18090 | KRW | 1'056'944'720.00 | USD | 800'000.00 |
| DAT029248 | | 13.06.23 | 1.02550 | NOK | 11'000'000.00 | SEK | 10'726'485.00 |
| DAT029249 | | 20.07.23 | 6.71000 | NOK | 26'839'988.00 | NZD | 4'000'000.00 |
| DAT029250 | | 13.06.23 | 0.97798 | SEK | 10'757'736.00 | NOK | 11'000'000.00 |
| DAT029251 | | 31.07.23 | 0.74446 | USD | 1'300'000.00 | CAD | 1'746'221.10 |
| DAT029257 | | 20.07.23 | 0.14985 | NZD | 4'000'000.00 | NOK | 26'693'680.00 |
| DAT029259 | | 13.06.23 | 1.02635 | NOK | 11'000'000.00 | SEK | 10'717'575.00 |
| DAT029260 | | 13.06.23 | 0.97760 | SEK | 10'753'628.60 | NOK | 11'000'000.00 |
| DAT029270 | | 13.06.23 | 0.99020 | SEK | 10'892'178.00 | NOK | 11'000'000.00 |
| DAT029277 | | 14.08.23 | 1.00030 | NOK | 80'000'000.00 | SEK | 79'976'080.00 |
| DAT029279 | | 14.08.23 | 174.39830 | JPY | 435'995'750.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029280 | | 14.08.23 | 1.00218 | SEK | 10'021'790.00 | NOK | 10'000'000.00 |
| DAT029281 | | 14.08.23 | 153.78346 | JPY | 1'900'000'000.00 | CHF | 12'355'035.00 |
| DAT029282 | | 14.08.23 | 0.61424 | USD | 4'361'086.96 | NZD | 7'100'000.00 |
| DAT029283 | | 14.08.23 | 0.05718 | USD | 5'300'000.00 | MXN | 92'682'107.00 |
| DAT029284 | | 14.08.23 | 84.98110 | JPY | 1'869'584'200.00 | NZD | 22'000'000.00 |
| DAT029285 | | 14.08.23 | 1.00505 | SEK | 10'050'542.00 | NOK | 10'000'000.00 |
| DAT029293 | | 14.08.23 | 1.00699 | SEK | 15'104'871.00 | NOK | 15'000'000.00 |
| DAT029294 | | 14.08.23 | 175.41599 | JPY | 438'539'975.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029295 | | 14.08.23 | 10.50411 | NOK | 10'504'111.00 | USD | 1'000'000.00 |
| DAT029296 | | 14.08.23 | 1.01144 | SEK | 15'171'624.00 | NOK | 15'000'000.00 |
| DAT029297 | | 14.08.23 | 1.01283 | SEK | 15'192'393.00 | NOK | 15'000'000.00 |
| DAT029298 | | 14.08.23 | 138.14946 | JPY | 828'896'760.00 | USD | 6'000'000.00 |
| DAT029299 | | 14.08.23 | 0.99452 | NOK | 15'000'000.00 | SEK | 15'082'647.00 |
| DAT029306 | | 14.08.23 | 0.00079 | USD | 1'200'000.00 | KRW | 1'523'995'200.00 |
| DAT029307 | | 14.08.23 | 177.63591 | JPY | 355'271'820.00 | GBP | 2'000'000.00 |
| DAT029311 | | 14.08.23 | 157.97327 | JPY | 300'000'000.00 | CHF | 1'899'055.50 |
| DAT029312 | | 14.08.23 | 6.55260 | NOK | 22'934'093.00 | NZD | 3'500'000.00 |
| DAT029313 | | 14.08.23 | 6.53685 | NOK | 22'878'971.50 | NZD | 3'500'000.00 |
| DAT029314 | | 14.08.23 | 140.39881 | JPY | 280'797'620.00 | USD | 2'000'000.00 |
| DAT029317 | | 14.08.23 | 1.16840 | EUR | 2'700'000.00 | GBP | 2'310'849.00 |
| DAT029318 | | 14.08.23 | 13.62735 | NOK | 34'068'375.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029322 | | 14.08.23 | 0.00712 | USD | 1'000'000.00 | JPY | 140'498'000.00 |
| DAT029323 | | 14.08.23 | 0.85744 | GBP | 2'315'074.50 | EUR | 2'700'000.00 |
| DAT029343 | | 14.08.23 | 0.97736 | CHF | 6'841'513.00 | EUR | 7'000'000.00 |
| DAT029344 | | 14.08.23 | 1.13497 | CHF | 2'269'934.00 | GBP | 2'000'000.00 |
| DAT029345 | | 14.08.23 | 154.70060 | JPY | 154'700'600.00 | EUR | 1'000'000.00 |
| DAT029346 | | 14.08.23 | 1.00730 | SEK | 15'109'470.00 | NOK | 15'000'000.00 |
| DAT029347 | | 14.08.23 | 140.95520 | JPY | 140'955'200.00 | USD | 1'000'000.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-------------|---------|------------------|---------|------------------|
| DAT029348 | | 14.08.23 | 0.00711 | USD | 1'000'000.00 | JPY | 140'698'100.00 |
| DAT029349 | | 14.08.23 | 0.07362 | GBP | 2'500'000.00 | NOK | 33'956'785.00 |
| DAT029350 | | 14.08.23 | 158.04255 | JPY | 700'000'000.00 | CHF | 4'429'187.00 |
| DAT029353 | | 14.08.23 | 1.01112 | NOK | 25'000'000.00 | SEK | 24'725'125.00 |
| DAT029354 | | 14.08.23 | 13.76488 | NOK | 34'412'195.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029355 | | 14.08.23 | 87.47740 | JPY | 174'954'800.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029357 | | 14.08.23 | 0.99192 | SEK | 24'798'100.00 | NOK | 25'000'000.00 |
| DAT029359 | | 14.08.23 | 0.07338 | GBP | 2'500'000.00 | NOK | 34'067'255.00 |
| DAT029360 | | 14.08.23 | 88.24429 | JPY | 88'244'290.00 | NZD | 1'000'000.00 |
| DAT029361 | | 14.08.23 | 88.14680 | JPY | 88'146'800.00 | NZD | 1'000'000.00 |
| DAT029362 | | 14.08.23 | 1.00610 | NOK | 30'000'000.00 | SEK | 29'817'990.00 |
| DAT029368 | | 14.08.23 | 0.01146 | NZD | 2'500'000.00 | JPY | 218'076'250.00 |
| DAT029369 | | 14.08.23 | 0.15269 | NZD | 2'500'000.00 | NOK | 16'372'710.00 |
| DAT029370 | | 14.08.23 | 0.99803 | SEK | 29'940'840.00 | NOK | 30'000'000.00 |
| DAT029371 | | 14.08.23 | 4'234.22100 | COP | 5'927'909'400.00 | USD | 1'400'000.00 |
| DAT029376 | | 14.08.23 | 156.89960 | JPY | 156'899'600.00 | EUR | 1'000'000.00 |
| DAT029377 | | 14.08.23 | 87.92650 | JPY | 87'926'500.00 | NZD | 1'000'000.00 |
| DAT029378 | | 14.08.23 | 182.49355 | JPY | 291'989'680.00 | GBP | 1'600'000.00 |
| DAT029379 | | 14.08.23 | 0.89066 | CHF | 1'335'990.00 | USD | 1'500'000.00 |
| DAT029396 | | 14.08.23 | 0.09255 | USD | 2'500'000.00 | SEK | 27'011'215.00 |
| DAT029398 | | 14.08.23 | 0.07390 | GBP | 500'000.00 | NOK | 6'765'688.00 |
| DAT029399 | | 14.08.23 | 88.90780 | JPY | 177'815'600.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029408 | | 14.08.23 | 0.01133 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 88'259'700.00 |
| DAT029409 | | 14.08.23 | 0.01129 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 88'554'300.00 |
| DAT029425 | | 14.08.23 | 0.00703 | USD | 2'000'000.00 | JPY | 284'695'200.00 |
| DAT029426 | | 14.08.23 | 0.00077 | USD | 500'000.00 | KRW | 652'044'500.00 |
| DAT029428 | | 14.08.23 | 0.07416 | GBP | 2'500'000.00 | NOK | 33'711'255.00 |
| DAT029429 | | 14.08.23 | 181.83410 | JPY | 363'668'200.00 | GBP | 2'000'000.00 |
| DAT029430 | | 14.08.23 | 0.00551 | GBP | 2'000'000.00 | JPY | 362'897'600.00 |
| DAT029432 | | 14.08.23 | 0.07469 | GBP | 1'000'000.00 | NOK | 13'387'804.00 |
| DAT029433 | | 14.08.23 | 0.01149 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 87'061'700.00 |
| DAT029434 | | 14.08.23 | 0.07424 | GBP | 500'000.00 | NOK | 6'734'937.00 |
| DAT029435 | | 14.08.23 | 0.01157 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 86'459'600.00 |
| DAT029436 | | 14.09.23 | 0.00078 | USD | 1'800'000.00 | KRW | 2'321'803'980.00 |
| DAT029444 | | 14.08.23 | 0.07548 | GBP | 3'000'000.00 | NOK | 39'743'274.00 |
| DAT029445 | | 14.09.23 | 1.48225 | AUD | 5'000'000.00 | USD | 3'373'240.00 |
| DAT029446 | | 14.09.23 | 0.67849 | USD | 3'392'460.00 | AUD | 5'000'000.00 |
| DAT029456 | | 14.09.23 | 86.91960 | JPY | 173'839'200.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029457 | | 14.09.23 | 160.38904 | JPY | 150'000'000.00 | CHF | 935'226.00 |
| DAT029458 | | 14.09.23 | 159.65591 | JPY | 150'000'000.00 | CHF | 939'520.50 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-------------|---------|------------------|---------|------------------|
| DAT029460 | | 14.09.23 | 0.00646 | EUR | 3'000'000.00 | JPY | 464'421'180.00 |
| DAT029462 | | 14.09.23 | 155.21100 | JPY | 155'211'000.00 | EUR | 1'000'000.00 |
| DAT029463 | | 14.09.23 | 0.01151 | NZD | 2'000'000.00 | JPY | 173'790'000.00 |
| DAT029464 | | 14.09.23 | 826.38600 | CLP | 1'156'940'400.00 | USD | 1'400'000.00 |
| DAT029471 | | 14.09.23 | 0.00620 | CHF | 1'861'485.00 | JPY | 300'000'000.00 |
| DAT029472 | | 14.08.23 | 0.00726 | USD | 1'200'000.00 | JPY | 165'347'400.00 |
| DAT029474 | | 14.09.23 | 0.00647 | EUR | 1'000'000.00 | JPY | 154'588'800.00 |
| DAT029475 | | 14.09.23 | 0.01165 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 85'836'900.00 |
| DAT029476 | | 14.08.23 | 13.19271 | NOK | 7'915'623.60 | GBP | 600'000.00 |
| DAT029477 | | 14.09.23 | 0.01160 | NZD | 1'000'000.00 | JPY | 86'170'300.00 |
| DAT029482 | | 14.08.23 | 12.92515 | NOK | 32'312'872.50 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029483 | | 14.09.23 | 0.01157 | NZD | 800'000.00 | JPY | 69'144'880.00 |
| DAT029484 | | 14.09.23 | 155.39840 | JPY | 155'398'400.00 | EUR | 1'000'000.00 |
| DAT029485 | | 14.09.23 | 87.01790 | JPY | 174'035'800.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029486 | | 31.07.23 | 1.31757 | CAD | 1'712'843.60 | USD | 1'300'000.00 |
| DAT029487 | | 14.08.23 | 0.90082 | GBP | 2'000'000.00 | CHF | 2'220'202.00 |
| DAT029488 | | 14.08.23 | 0.07739 | GBP | 1'300'000.00 | NOK | 16'798'072.20 |
| DAT029496 | | 14.08.23 | 0.01146 | NZD | 2'000'000.00 | JPY | 174'517'660.00 |
| DAT029500 | | 31.07.23 | 0.00078 | USD | 800'000.00 | KRW | 1'023'503'120.00 |
| DAT029501 | | 14.09.23 | 4'033.10700 | COP | 1'613'242'800.00 | USD | 400'000.00 |
| DAT029502 | | 14.09.23 | 0.00078 | USD | 1'200'000.00 | KRW | 1'530'258'240.00 |
| DAT029504 | | 14.09.23 | 3.61236 | PEN | 5'779'777.60 | USD | 1'600'000.00 |
| DAT029511 | | 14.09.23 | 85.85610 | JPY | 171'712'200.00 | NZD | 2'000'000.00 |
| DAT029512 | | 14.08.23 | 1.15487 | USD | 1'500'000.00 | CHF | 1'298'850.00 |
| DAT029515 | | 14.09.23 | 156.41710 | JPY | 187'700'520.00 | EUR | 1'200'000.00 |
| DAT029526 | | 14.09.23 | 0.00644 | EUR | 600'000.00 | JPY | 93'223'260.00 |
| DAT029528 | | 14.09.23 | 0.00640 | EUR | 2'000'000.00 | JPY | 312'425'400.00 |
| DAT029531 | | 14.09.23 | 162.61538 | JPY | 300'000'000.00 | CHF | 1'844'844.00 |
| DAT029532 | | 14.09.23 | 156.02010 | JPY | 624'080'400.00 | EUR | 4'000'000.00 |
| DAT029536 | | 10.10.23 | 157.73526 | JPY | 189'282'312.00 | EUR | 1'200'000.00 |
| DAT029537 | | 10.10.23 | 164.41500 | JPY | 1'200'000'000.00 | CHF | 7'298'604.00 |
| DAT029538 | | 10.10.23 | 142.50925 | JPY | 213'763'875.00 | USD | 1'500'000.00 |
| DAT029540 | | 10.10.23 | 157.63820 | JPY | 1'261'105'600.00 | EUR | 8'000'000.00 |
| DAT029541 | | 10.10.23 | 164.65350 | JPY | 600'000'000.00 | CHF | 3'644'016.00 |
| DAT029542 | | 10.10.23 | 182.15355 | JPY | 1'001'844'525.00 | GBP | 5'500'000.00 |
| DAT029543 | | 10.10.23 | 85.91456 | JPY | 1'288'718'400.00 | NZD | 15'000'000.00 |
| DAT029544 | | 10.10.23 | 0.05809 | USD | 4'500'000.00 | MXN | 77'471'928.00 |
| DAT029547 | | 10.10.23 | 85.99815 | JPY | 1'289'972'250.00 | NZD | 15'000'000.00 |
| DAT029548 | | 10.10.23 | 0.05817 | USD | 1'500'000.00 | MXN | 25'784'806.50 |
| DAT029549 | | 14.09.23 | 4'066.29400 | COP | 5'286'182'200.00 | USD | 1'300'000.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-------------|---------|------------------|---------|------------------|
| DAT029571 | | 14.09.23 | 0.00607 | CHF | 606'698.00 | JPY | 100'000'000.00 |
| DAT029573 | | 10.10.23 | 0.09130 | USD | 3'800'000.00 | SEK | 41'622'000.40 |
| DAT029582 | | 10.10.23 | 0.00638 | EUR | 600'000.00 | JPY | 93'971'400.00 |
| DAT029591 | | 10.10.23 | 0.00076 | USD | 1'300'000.00 | KRW | 1'716'170'300.00 |
| DAT029649 | | 27.10.23 | 0.24060 | USD | 900'000.00 | PLN | 3'740'661.00 |
| DAT029658 | | 10.10.23 | 146.78680 | JPY | 220'180'200.00 | USD | 1'500'000.00 |
| DAT029660 | | 10.10.23 | 0.00634 | EUR | 1'500'000.00 | JPY | 236'420'400.00 |
| DAT029661 | | 10.10.23 | 0.00542 | GBP | 2'000'000.00 | JPY | 368'986'420.00 |
| DAT029675 | | 10.10.23 | 0.00683 | USD | 1'500'000.00 | JPY | 219'566'400.00 |
| DAT029697 | | 27.10.23 | 182.06800 | JPY | 91'034.00 | GBP | 500.00 |
| DAT029704 | | 10.10.23 | 11.42253 | NOK | 22'845'058.00 | EUR | 2'000'000.00 |
| DAT029709 | | 14.11.23 | 164.36042 | JPY | 250'000'000.00 | CHF | 1'521'047.50 |
| DAT029710 | | 14.11.23 | 85.94599 | JPY | 103'135'188.00 | NZD | 1'200'000.00 |
| DAT029711 | | 14.11.23 | 156.63140 | JPY | 219'283'960.00 | EUR | 1'400'000.00 |
| DAT029712 | | 14.11.23 | 93.70110 | JPY | 187'402'200.00 | AUD | 2'000'000.00 |
| DAT029717 | | 10.10.23 | 0.89046 | CHF | 1'424'737.60 | USD | 1'600'000.00 |
| DAT029720 | | 14.11.23 | 3.71364 | PEN | 5'199'091.80 | USD | 1'400'000.00 |
| DAT029726 | | 14.11.23 | 13.29350 | NOK | 33'233'745.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029731 | | 06.12.23 | 899.53000 | CLP | 989'483'000.00 | USD | 1'100'000.00 |
| DAT029735 | | 14.11.23 | 0.07591 | GBP | 2'500'000.00 | NOK | 32'932'862.50 |
| DAT029736 | | 14.11.23 | 179.97340 | JPY | 449'933'500.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029739 | | 14.11.23 | 0.00615 | CHF | 2'458'817.20 | JPY | 400'000'000.00 |
| DAT029755 | | 14.11.23 | 147.84760 | JPY | 295'695'200.00 | USD | 2'000'000.00 |
| DAT029757 | | 10.10.23 | 0.08850 | EUR | 2'000'000.00 | NOK | 22'600'136.00 |
| DAT029758 | | 14.11.23 | 148.17390 | JPY | 148'173'900.00 | USD | 1'000'000.00 |
| DAT029785 | | 10.10.23 | 0.01131 | NZD | 300'000.00 | JPY | 26'519'610.00 |
| DAT029787 | | 10.10.23 | 162.62728 | JPY | 50'000'000.00 | CHF | 307'451.50 |
| DAT029794 | | 06.12.23 | 1.57225 | AUD | 11'000'000.00 | USD | 6'996'330.00 |
| DAT029795 | | 06.12.23 | 1.04279 | EUR | 600'000.00 | CHF | 575'382.00 |
| DAT029796 | | 06.12.23 | 4'388.33200 | COP | 6'143'664'800.00 | USD | 1'400'000.00 |
| DAT029797 | | 06.12.23 | 147.76193 | JPY | 295'523'860.00 | USD | 2'000'000.00 |
| DAT029798 | | 06.12.23 | 163.20810 | JPY | 2'000'000'000.00 | CHF | 12'254'294.00 |
| DAT029799 | | 06.12.23 | 180.56330 | JPY | 180'563'300.00 | GBP | 1'000'000.00 |
| DAT029800 | | 06.12.23 | 0.09126 | USD | 3'800'000.00 | SEK | 41'641'208.26 |
| DAT029801 | | 06.12.23 | 0.05421 | USD | 6'000'000.00 | MXN | 110'674'338.00 |
| DAT029802 | | 06.12.23 | 88.16780 | JPY | 2'821'369'600.00 | NZD | 32'000'000.00 |
| DAT029809 | | 06.12.23 | 155.56910 | JPY | 622'276'400.00 | EUR | 4'000'000.00 |
| DAT029813 | | 06.12.23 | 0.64221 | USD | 1'284'420.00 | AUD | 2'000'000.00 |
| DAT029822 | | 06.12.23 | 0.64239 | USD | 1'284'788.00 | AUD | 2'000'000.00 |
| DAT029837 | | 06.12.23 | 180.54573 | JPY | 451'364'325.00 | GBP | 2'500'000.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-----------|---------|------------------|---------|------------------|
| DAT029838 | | 06.12.23 | 1.14655 | AUD | 4'000'000.00 | CAD | 3'488'728.00 |
| DAT029840 | | 06.12.23 | 0.73399 | USD | 3'700'000.00 | CAD | 5'040'931.80 |
| DAT029895 | | 06.12.23 | 0.21116 | CHF | 781'287.93 | PLN | 3'700'000.00 |
| DAT029896 | | 06.12.23 | 0.88088 | CAD | 1'321'314.00 | AUD | 1'500'000.00 |
| DAT029907 | | 06.12.23 | 1.57781 | AUD | 1'000'000.00 | USD | 633'790.00 |
| DAT029908 | | 06.12.23 | 0.63763 | USD | 637'625.00 | AUD | 1'000'000.00 |
| DAT029909 | | 06.12.23 | 0.88689 | CAD | 2'394'597.60 | AUD | 2'700'000.00 |
| DAT029913 | | 06.12.23 | 0.88908 | CAD | 4'712'129.30 | AUD | 5'300'000.00 |
| DAT029914 | | 06.12.23 | 1.12907 | AUD | 4'000'000.00 | CAD | 3'542'728.00 |
| DAT029915 | | 06.12.23 | 0.00075 | USD | 3'600'000.00 | KRW | 4'780'886'400.00 |
| DAT029916 | | 06.12.23 | 1.71914 | AUD | 5'000'000.00 | CHF | 2'908'435.00 |
| DAT029918 | | 06.12.23 | 1.64775 | AUD | 4'119'382.50 | EUR | 2'500'000.00 |
| DAT029921 | | 06.12.23 | 1.66487 | AUD | 4'994'595.00 | EUR | 3'000'000.00 |
| DAT029922 | | 06.12.23 | 160.39130 | JPY | 400'978'250.00 | EUR | 2'500'000.00 |
| DAT029926 | | 06.12.23 | 0.60293 | EUR | 3'000'000.00 | AUD | 4'975'704.00 |
| DAT029931 | | 06.12.23 | 1.14563 | EUR | 3'200'000.00 | GBP | 2'793'225.60 |
| DAT029932 | | 06.12.23 | 1.22860 | USD | 1'228'604.00 | GBP | 1'000'000.00 |
| DAT029938 | | 06.12.23 | 161.01300 | JPY | 161'013'000.00 | EUR | 1'000'000.00 |
| DAT029946 | | 12.01.24 | 0.00596 | CHF | 894'657.00 | JPY | 150'000'000.00 |
| DAT029947 | | 12.01.24 | 95.88036 | JPY | 191'760'720.00 | AUD | 2'000'000.00 |
| DAT029948 | | 12.01.24 | 150.14153 | JPY | 450'424'590.00 | USD | 3'000'000.00 |
| DAT029949 | | 12.01.24 | 184.07860 | JPY | 460'196'500.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT029950 | | 12.01.24 | 88.26469 | JPY | 132'397'035.00 | NZD | 1'500'000.00 |
| DAT029964 | | 06.12.23 | 163.54915 | JPY | 294'388'470.00 | EUR | 1'800'000.00 |
| DAT029965 | | 16.01.24 | 0.09262 | USD | 3'000'000.00 | NOK | 32'389'266.00 |
| DAT029966 | | 16.01.24 | 1.53359 | AUD | 5'000'000.00 | USD | 3'260'315.00 |
| DAT029967 | | 16.01.24 | 10.83849 | NOK | 32'515'467.00 | USD | 3'000'000.00 |
| DAT029968 | | 06.12.23 | 0.89103 | CAD | 3'564'112.00 | AUD | 4'000'000.00 |
| DAT029976 | | 16.01.24 | 0.65133 | USD | 1'628'317.50 | AUD | 2'500'000.00 |
| DAT029978 | | 06.12.23 | 1.73100 | AUD | 3'500'000.00 | CHF | 2'021'958.40 |
| DAT029979 | | 16.01.24 | 0.65614 | USD | 1'640'350.00 | AUD | 2'500'000.00 |
| DAT029989 | | 12.01.24 | 1.80000 | NZD | 4'500'010.00 | EUR | 2'500'000.00 |
| DAT029990 | | 06.12.23 | 0.58028 | CHF | 2'321'132.00 | AUD | 4'000'000.00 |
| DAT030026 | | 12.01.24 | 0.55551 | EUR | 2'500'000.00 | NZD | 4'500'355.00 |
| DAT030042 | | 12.01.24 | 0.00622 | EUR | 500'000.00 | JPY | 80'437'450.00 |
| DAT030050 | | 12.01.24 | 169.63269 | JPY | 150'000'000.00 | CHF | 884'263.50 |
| DAT030054 | | 12.01.24 | 185.74410 | JPY | 185'744'100.00 | GBP | 1'000'000.00 |
| DAT030066 | | 06.12.23 | 0.61244 | EUR | 2'500'000.00 | AUD | 4'082'057.50 |
| DAT030072 | | 12.01.24 | 0.12885 | EUR | 2'000'000.00 | CNY | 15'521'382.00 |
| DAT030091 | | 04.03.24 | 89.33734 | JPY | 2'858'794'880.00 | NZD | 32'000'000.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-------------|---------|------------------|---------|------------------|
| DAT030092 | | 04.03.24 | 167.54628 | JPY | 2'000'000'000.00 | CHF | 11'937'000.00 |
| DAT030093 | | 04.03.24 | 144.74990 | JPY | 289'499'800.00 | USD | 2'000'000.00 |
| DAT030094 | | 04.03.24 | 182.83720 | JPY | 457'093'000.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT030097 | | 04.03.24 | 0.05630 | USD | 6'000'000.00 | MXN | 106'563'420.00 |
| DAT030099 | | 04.03.24 | 157.38850 | JPY | 314'777'000.00 | EUR | 2'000'000.00 |
| DAT030102 | | 04.03.24 | 0.09622 | USD | 4'500'000.00 | SEK | 46'768'711.50 |
| DAT030104 | | 04.03.24 | 182.89680 | JPY | 1'646'071'200.00 | GBP | 9'000'000.00 |
| DAT030105 | | 12.02.24 | 1.64736 | AUD | 8'236'775.00 | EUR | 5'000'000.00 |
| DAT030107 | | 04.03.24 | 0.91388 | GBP | 1'100'000.00 | CHF | 1'203'655.31 |
| DAT030108 | | 12.02.24 | 0.60991 | EUR | 2'600'000.00 | AUD | 4'262'892.40 |
| DAT030109 | | 12.02.24 | 0.60910 | EUR | 2'600'000.00 | AUD | 4'268'609.80 |
| DAT030115 | | 12.02.24 | 0.60991 | EUR | 2'600'000.00 | AUD | 4'262'949.60 |
| DAT030116 | | 04.03.24 | 0.00696 | USD | 800'000.00 | JPY | 114'871'984.00 |
| DAT030117 | | 04.03.24 | 0.01059 | AUD | 3'000'000.00 | JPY | 283'182'360.00 |
| DAT030122 | | 04.03.24 | 0.00077 | USD | 3'900'000.00 | KRW | 5'078'775'000.00 |
| DAT030128 | | 04.03.24 | 165.18305 | JPY | 700'000'000.00 | CHF | 4'237'723.00 |
| DAT030129 | | 04.03.24 | 884.66700 | CLP | 707'733'600.00 | USD | 800'000.00 |
| DAT030130 | | 04.03.24 | 883.88000 | CLP | 441'940'000.00 | USD | 500'000.00 |
| DAT030144 | | 04.03.24 | 1.06282 | EUR | 5'000'000.00 | CHF | 4'704'450.00 |
| DAT030148 | | 04.03.24 | 0.00606 | CHF | 909'028.50 | JPY | 150'000'000.00 |
| DAT030151 | | 04.03.24 | 4'064.00000 | COP | 4'064'000'000.00 | USD | 1'000'000.00 |
| DAT030153 | | 04.03.24 | 3.78350 | PEN | 4'918'550.00 | USD | 1'300'000.00 |
| DAT030154 | | 04.03.24 | 10.76224 | NOK | 53'811'175.00 | USD | 5'000'000.00 |
| DAT030155 | | 04.03.24 | 0.09295 | USD | 5'000'000.00 | NOK | 53'791'610.00 |
| DAT030158 | | 04.03.24 | 0.94708 | CHF | 2'841'234.00 | EUR | 3'000'000.00 |
| DAT030159 | | 04.03.24 | 0.94562 | CHF | 1'891'238.00 | EUR | 2'000'000.00 |
| DAT030163 | | 04.03.24 | 1.06069 | EUR | 3'000'000.00 | CHF | 2'828'340.00 |
| DAT030164 | | 04.03.24 | 166.16374 | JPY | 300'000'000.00 | CHF | 1'805'448.00 |
| DAT030167 | | 04.03.24 | 12.99036 | NOK | 116'913'204.00 | GBP | 9'000'000.00 |
| DAT030172 | | 04.03.24 | 0.07678 | GBP | 3'000'000.00 | NOK | 39'071'052.00 |
| DAT030173 | | 04.03.24 | 0.07691 | GBP | 4'000'000.00 | NOK | 52'007'676.00 |
| DAT030174 | | 04.03.24 | 1.06592 | EUR | 2'500'000.00 | CHF | 2'345'400.00 |
| DAT030175 | | 04.03.24 | 0.07703 | GBP | 2'000'000.00 | NOK | 25'962'316.00 |
| DAT030176 | | 04.03.24 | 0.92801 | GBP | 2'300'000.00 | CHF | 2'478'417.44 |
| DAT030208 | | 04.03.24 | 1.19489 | USD | 1'500'000.00 | CHF | 1'255'345.50 |
| DAT030209 | | 04.03.24 | 0.00561 | GBP | 2'000'000.00 | JPY | 356'513'800.00 |
| DAT030210 | | 04.03.24 | 0.01128 | NZD | 1'500'000.00 | JPY | 132'929'700.00 |
| DAT030215 | | 04.03.24 | 0.84531 | CHF | 676'248.80 | USD | 800'000.00 |
| DAT030225 | | 04.03.24 | 12.18383 | NOK | 20'000'000.00 | CHF | 1'641'520.00 |
| DAT030227 | | 04.03.24 | 0.92355 | GBP | 5'000'000.00 | CHF | 5'413'870.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|-------------|----------|-----------|---------|----------------|---------|----------------|
| DAT030231 | | 04.03.24 | 0.08240 | CHF | 1'647'960.00 | NOK | 20'000'000.00 |
| DAT030290 | | 04.03.24 | 0.05011 | CHF | 30'066.78 | MXN | 600'000.00 |
| DAT030291 | | 04.03.24 | 0.05013 | CHF | 501'331.00 | MXN | 10'000'000.00 |
| DAT030292 | | 04.03.24 | 0.12762 | EUR | 1'700'000.00 | CNY | 13'321'251.00 |
| DAT030293 | | 04.03.24 | 1.09798 | CHF | 4'940'892.00 | GBP | 4'500'000.00 |
| DAT030297 | | 04.03.24 | 159.98440 | JPY | 479'953'200.00 | EUR | 3'000'000.00 |
| DAT030319 | | 04.03.24 | 0.91094 | GBP | 4'500'000.00 | CHF | 4'939'947.00 |
| DAT030342 | | 04.03.24 | 159.51710 | JPY | 797'585'500.00 | EUR | 5'000'000.00 |
| DAT030350 | | 04.03.24 | 0.00629 | EUR | 2'500'000.00 | JPY | 397'723'250.00 |
| DAT030351 | | 04.03.24 | 0.00630 | EUR | 2'500'000.00 | JPY | 396'743'000.00 |
| DAT030356 | | 04.03.24 | 1.09807 | CHF | 2'196'130.00 | GBP | 2'000'000.00 |
| DAT030357 | | 04.03.24 | 0.93740 | CHF | 2'343'500.00 | EUR | 2'500'000.00 |
| DAT030358 | | 04.03.24 | 1.10047 | CHF | 2'751'175.00 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT030361 | | 04.03.24 | 0.94006 | CHF | 2'820'183.00 | EUR | 3'000'000.00 |
| DAT030363 | | 04.03.24 | 20.65305 | JPY | 200'000'000.00 | CNY | 9'683'800.00 |
| DAT030364 | | 04.03.24 | 0.60431 | EUR | 3'000'000.00 | AUD | 4'964'361.00 |
| DAT030365 | | 04.03.24 | 1.10332 | CHF | 772'326.80 | GBP | 700'000.00 |
| DAT030390 | | 04.03.24 | 0.94703 | CHF | 1'894'054.00 | EUR | 2'000'000.00 |
| DAT030391 | | 04.03.24 | 0.89987 | GBP | 2'500'000.00 | CHF | 2'778'187.50 |
| DAT030394 | | 04.03.24 | 0.90448 | GBP | 2'500'000.00 | CHF | 2'764'020.00 |
| DAT030409 | | 04.03.24 | 1.10991 | CHF | 2'774'782.50 | GBP | 2'500'000.00 |
| DAT030411 | | 04.03.24 | 1.11195 | CHF | 2'779'882.50 | GBP | 2'500'000.00 |

Futures

| | | | | | | | |
|--------------|----------------------|----------|--|--|----------|--|----------|
| CBOT.TN20623 | US T-NOTES 2 Y | 30.06.23 | | | 250.00 | | 260.00 |
| CBOT.TN20624 | US T-NOTES 2 Y | 30.06.24 | | | 297.00 | | 297.00 |
| CBOT.TN20923 | US T-NOTES 2 Y | 30.09.23 | | | 2'100.00 | | 2'100.00 |
| CBOT.TN21223 | US T-NOTES 2 Y | 31.12.23 | | | 1'394.00 | | 1'394.00 |
| CBOT.TN50324 | US T-NOTES 5 Y | 31.03.24 | | | 430.00 | | 430.00 |
| CBOT.TN50923 | US T-NOTES 5 Y | 30.09.23 | | | 1'500.00 | | 1'500.00 |
| CBOT.TN51223 | US T-NOTES 5 Y | 31.12.23 | | | 1'180.00 | | 1'180.00 |
| CBOT.UL10324 | US ULTRABOND 10 YEAR | 31.03.24 | | | 250.00 | | 250.00 |
| CBOT.UL10923 | US ULTRABOND 10 YEAR | 30.09.23 | | | 520.00 | | 520.00 |
| CBOT.UL11223 | US ULTRABOND 10 YEAR | 31.12.23 | | | 360.00 | | 360.00 |
| CBOT.ULT0324 | US ULTRABOND 30 YEAR | 31.03.24 | | | 120.00 | | 120.00 |
| EURO.SH0324 | EURO SCHATZ EUREX | 31.03.24 | | | 2'500.00 | | 2'500.00 |
| EURO.SH0623 | EURO SCHATZ EUREX | 30.06.23 | | | 625.00 | | 625.00 |
| EURO.SH0923 | EURO SCHATZ EUREX | 30.09.23 | | | 2'910.00 | | 2'910.00 |
| EURO.SH1223 | EURO SCHATZ EUREX | 31.12.23 | | | 750.00 | | 750.00 |
| EURX.BD0324 | EUREX EURO BUND | 31.03.24 | | | 800.00 | | 800.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

| Code instrument | Désignation | Echéance | Change | Monnaie | Achats | Monnaie | Ventes |
|-----------------|----------------------|----------|--------|---------|----------|---------|----------|
| EURX.BD0623 | EUREX EURO BUND | 30.06.23 | | | 235.00 | | 235.00 |
| EURX.BD0624 | EUREX EURO BUND | 30.06.24 | | | 150.00 | | 150.00 |
| EURX.BD0923 | EUREX EURO BUND | 30.09.23 | | | 1'270.00 | | 1'270.00 |
| EURX.BD1223 | EUREX EURO BUND | 31.12.23 | | | 740.00 | | 740.00 |
| EURX.BD30324 | EUREX EURO BUND 30 Y | 31.03.24 | | | 445.00 | | 445.00 |
| EURX.BD31223 | EUREX EURO BUND 30 Y | 31.12.23 | | | 218.00 | | 218.00 |
| EURX.BOB0324 | EURO-BOBL | 31.03.24 | | | 599.00 | | 599.00 |
| EURX.BOB0923 | EURO-BOBL | 30.09.23 | | | 650.00 | | 650.00 |
| EURX.BOB1223 | EURO-BOBL | 31.12.23 | | | 100.00 | | 100.00 |
| LIF.LG0324 | LONG GILT | 31.03.24 | | | 549.00 | | 549.00 |
| LIF.LG0923 | LONG GILT | 30.09.23 | | | 450.00 | | 450.00 |
| LIF.LG1223 | LONG GILT | 31.12.23 | | | 330.00 | | 330.00 |

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

Notes aux états financiers

Commissions Situation jusqu'au 31.12.23

| AMC PROFESSIONAL FUND – BCV Fiscal Strength Government Bonds | Commission de gestion forfaitaire annuelle appliquée à la charge de la fortune du fonds | Commissions à la charge de l'investisseur | | |
|--|--|---|--|-----------|
| | | Commission d'émission en faveur des promoteurs de vente | Indemnité pour frais accessoires en faveur de la fortune du fonds | |
| | | | A l'émission | Au rachat |
| Classe B | 0.40%* | Max. 1.75% | Max. 0.80% | |
| Classe C | 0.30%* | | | |
| Classe Z | 0.09%* | | | |

* En cas d'investissement dans des fonds cibles liés (tels que définis dans le contrat de fonds), la direction du fonds peut décider de prélever une commission de gestion forfaitaire réduite. Dans un tel cas, le taux annuel appliqué pour cette commission sera alors inférieur à celui indiqué dans le tableau ci-dessus.

Situation dès le 01.01.24

| AMC PROFESSIONAL FUND – BCV Fiscal Strength Government Bonds | Commission de gestion forfaitaire annuelle appliquée à la charge de la fortune du fonds | Commissions à la charge de l'investisseur | | |
|---|--|---|--|------------|
| | | Commission d'émission en faveur des promoteurs de vente | Indemnité pour frais accessoires en faveur de la fortune du fonds | |
| | | | A l'émission | Au rachat |
| Classe B | 0.40%* | Max. 1.00% | Max. 0.80% | Max. 0.50% |
| Classe C | 0.30%* | | | |
| Classe Z | 0.09%* | | | |

* En cas d'investissement dans des fonds cibles liés (tels que définis dans le contrat de fonds), la direction du fonds peut décider de prélever une commission de gestion forfaitaire réduite. Dans un tel cas, le taux annuel appliqué pour cette commission sera alors inférieur à celui indiqué dans le tableau ci-dessus.

Dans les limites du contrat de fonds, la direction du fonds et ses mandataires peuvent payer des rétrocessions pour indemniser les activités de promotion de la vente. Ils n'accordent aucun rabais pour réduire les frais et coûts revenant aux investisseurs et imputés au fonds.

La direction du fonds n'a pas conclu de Soft Commission Agreements.

Le taux maximum de la commission de gestion des fonds cibles dans lesquels le fonds peut investir est de 3%.

Calcul et évaluation de la valeur nette d'inventaire

La valeur nette d'inventaire d'une part d'une classe du fonds est déterminée à la fin de l'exercice comptable et chaque jour où des parts sont émises ou rachetées. Les jours où les bourses ou marchés des principaux pays de placement du fonds sont fermés (par exemple, jours bancaires et boursiers fériés), il n'est pas effectué de calcul.

La valeur nette d'inventaire d'une part d'une classe du fonds peut également être déterminée à des dates auxquelles des parts ne sont pas émises ou rachetées, à des fins de calculs et mesures de la performance ou de calculs de commissions exclusivement. Elle ne peut en aucun cas servir de base à des ordres de souscription ou de rachat de parts.

Les placements négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public doivent être évalués selon les cours actuels payés sur le marché principal. Les autres placements ou les placements pour lesquels aucun cours du jour n'est disponible doivent être évalués au prix qui pourrait en être obtenu s'ils étaient vendus avec soin au moment de l'évaluation. Pour déterminer la valeur vénale, la direction du fonds utilise dans ce cas des modèles et des principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique.

Les placements collectifs de capitaux sont évalués à leur prix de rachat ou à leur valeur nette d'inventaire. S'ils sont négociés régulièrement en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public, la direction du fonds peut les évaluer selon le paragraphe ci-dessus. Si une valeur nette d'inventaire n'est pas disponible ou disponible uniquement sur une base estimative, la direction du fonds évalue cette valeur au prix probable réalisable avec diligence au moment de l'évaluation en utilisant des modèles et des principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique (Fair Value). Elle peut se baser sur des données fournies par les dépositaires, administrateurs ou gestionnaires des fonds cibles.

Les avoirs en banque sont évalués à hauteur du montant de la créance plus les intérêts courus. En cas de changements notables des conditions du marché ou de la solvabilité, la base d'évaluation des avoirs en banque à terme est adaptée aux nouvelles circonstances.

La valeur nette d'inventaire d'une part d'une classe du fonds résulte de la quote-part de la valeur vénale de la fortune du fonds attribuable à la classe en question, réduite d'éventuels engagements attribuables à cette classe, divisée par le nombre de parts en circulation de cette même classe. La valeur nette d'inventaire est arrondie à deux décimales.

Rapport de performance

| | | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 au 31 mars |
|---------------------------------|---|-------|--------|-------|-----------------------|
| Performance : | | | | | |
| – Classe B (lancée le 06.09.17) | % | -3.57 | -16.56 | -4.90 | 3.71 |
| – Classe C (lancée le 14.06.17) | % | -3.47 | -16.47 | -4.79 | 3.74 |
| – Classe Z (lancée le 14.06.17) | % | -3.27 | -16.30 | -4.61 | 3.80 |

Notes

1. La performance a été calculée et est publiée conformément à la directive de l'Asset Management Association Switzerland AMAS.
2. Le fonds n'ayant pas d'indice de référence, sa performance n'est pas comparée à un tel indice.
3. Les chiffres figurant dans le tableau ci-dessus sont calculés sur une base annuelle sauf pour l'année de lancement (le début de la période est indiqué dans ledit tableau) et pour l'année de clôture (la fin de la période correspond à la date du présent rapport).
4. La performance historique ne représente pas un indicateur de performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission ou du rachat des parts.

Rapport abrégé de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs

à l'attention du Conseil d'administration de la direction de fonds Gérifonds SA,
Lausanne

Rapport abrégé sur l'audit des comptes annuels

Opinion d'audit

Nous avons effectué l'audit des comptes annuels du fonds de placement AMC PROFESSIONAL FUND avec les compartiments :

- BCV CHF Domestic Corporate Bonds
- BCV CHF Foreign Bonds
- BCV Enhanced Europe Equity ESG
- BCV Enhanced US Equity ESG
- BCV Fiscal Strength Government Bonds
- BCV International Bonds (CHF)
- BCV Japac ESG
- BCV Pro Patrimoine CHF
- BCV Swiss Equity
- BCV Swiss Equity Dividend Select
- BCV Swiss Franc Bonds ESG
- BCV Swiss Franc Credit Bonds
- BCV Swiss Small & Mid Caps Equity
- BCV Systematic Premia Europe Equity ESG
- BCV Systematic Premia Swiss Equity
- BCV Systematic Premia US Equity ESG
- BCV Total Return Bonds (CHF)

– comprenant le compte de fortune au 31 mars 2024, le compte de résultat pour l'exercice clos à cette date, les indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b–h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC).

Selon notre appréciation, les comptes annuels ci-joints sont conformes à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus.

Fondement de l'opinion d'audit

Nous avons effectué notre audit conformément à la loi suisse et aux Normes suisses d'audit des états financiers (NA-CH). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces dispositions et de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels » de notre rapport. Nous sommes indépendants du fonds de placement ainsi que de la direction de fonds, conformément aux dispositions légales suisses et aux exigences de la profession, et avons satisfait aux autres obligations éthiques professionnelles qui nous incombent dans le respect de ces exigences.

Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Responsabilités du Conseil d'administration de la direction de fonds relatives aux comptes annuels

Le Conseil d'administration de la direction de fonds est responsable de l'établissement des comptes annuels conformément à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus. Il est en outre responsable des contrôles internes qu'il juge nécessaires pour permettre l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels

Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, et de délivrer un rapport contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, mais ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément à la loi suisse et aux NA-CH permettra de toujours détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, prises individuellement ou dans leur ensemble, elles puissent influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes annuels prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit conforme à la loi suisse et aux NA-CH, nous exerçons notre jugement professionnel tout au long de l'audit et faisons preuve d'esprit critique. En outre:

- Nous identifions et évaluons les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant de fraudes est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, des omissions volontaires, de fausses déclarations ou le contournement de contrôles internes.
- Nous acquérons une compréhension du système de contrôle interne de la direction de fonds pertinent pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, mais non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du système de contrôle interne du fonds de placement.
- Nous évaluons le caractère approprié des méthodes comptables appliquées et le caractère raisonnable des estimations comptables ainsi que des informations y afférentes.

Nous communiquons au Conseil d'administration de la direction de fonds, notamment l'étendue des travaux d'audit et le calendrier de réalisation prévus et nos constatations d'audit importantes, y compris toute déficience majeure dans le système de contrôle interne, relevée au cours de notre audit.

PricewaterhouseCoopers SA

Jean-Sébastien Lassonde

Francis Brisson

Expert-réviseur agréé
Auditeur responsable

Genève, 11 juillet 2024

Annexe:

Comptes annuels comprenant le compte de fortune au 31 mars 2024, le compte de résultat pour l'exercice arrêté à cette date, des indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts, ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b–h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC)